富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)

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)	128,409,000.90
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(2014年10月01日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	25,240,473.59
2.本期利润	17,710,216.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.1149
4.期末基金资产净值	190,005,159.97
5.期末基金份额净值	1.480

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。

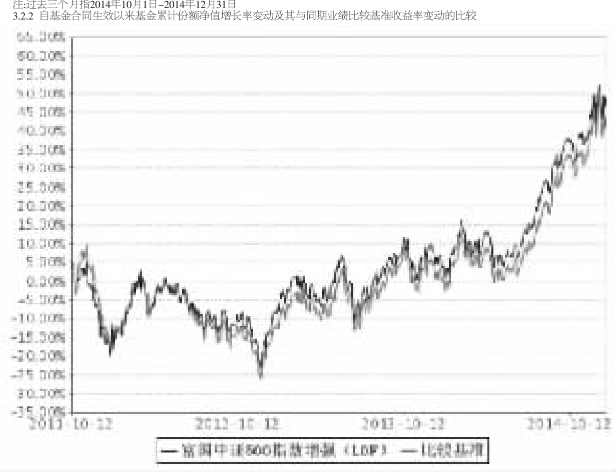
3.2 基金净值表现

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	8.74%	1.30%	8.15%	1.37%	0.59%	-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:1.截止日期为2014年12月31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	-	12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;兼任量化与海外投资部总经理;具有基金从业资格。
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	-	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500指数增强型证券投资基金(LOF)、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深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基金经理。具有基金从业资格。

注:基金管理人已于2015年1月10日发布《富国基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》,李笑薇女士自2015年1月9日起任富国基金管理有限公司副总经理。

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,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1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,持续超预期的强势表现。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。中证500指数整体表现比较平稳,四季度上涨8.27%。
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0.79%。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,本基金净值增长率8.74%,同期业绩比较基准收益率为8.15%。
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	180,256,243.70	89.28
	其中:股票	180,256,243.70	89.28
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	12,005,521.64	5.95
7	其他资产	9,647,663.45	4.78
8	合计	201,909,428.79	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	427,522.00	0.23
B	采矿业	-	-
C	制造业	22,556,764.52	11.87
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	98,790.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	74,700.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,894,135.60	1.52
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,404,292.13	0.74
L	租赁和商务服务业	2,003,259.52	1.05
M	科学研究和技术服务业	1,212,185.00	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	213,603.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	318,681.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	730,319.00	0.38
S	综合	-	-
	合计	31,934,251.77	16.81

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	2,917,497.00	1.54
B	采矿业	5,803,594.00	3.05
C	制造业	83,635,262.72	44.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,296,756.30	1.74
E	建筑业	2,690,579.20	1.42
F	批发和零售业	5,427,125.85	2.86
G	交通运输、仓储和邮政业	8,443,397.00	4.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,395,888.86	3.89
J	金融业	4,841,154.00	2.55
K	房地产业	14,360,691.00	7.56
L	租赁和商务服务业	2,565,919.00	1.35
M	科学研究和技术服务业	2,248,305.00	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	35,648.00	0.02
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	2,340,324.00	1.23
S	综合	2,319,850.00	1.22
	合计	148,321,991.93	78.06

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	600428	中远航运	375,200	3,001,600.00	1.58
2	601872	招商轮船	410,800	2,583,932.00	1.36
3	600201	金宇集团	70,160	2,461,212.80	1.30
4	000926	福星股份	219,000	2,356,440.00	1.24
5	300144	宋城演艺	77,700	2,340,324.00	1.23
6	600805	悦达投资	205,220	2,318,986.00	1.22
7	601099	太平洋	161,400	2,295,108.00	1.21
8	600645	中源协和	55,500	2,248,305.00	1.18
9	600426	华鲁恒升	204,200	2,233,948.00	1.18
10	600720	祁连山	203,637	2,233,897.89	1.18

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	002202	金风科技	124,100	1,753,533.00	0.92
2	600887	伊利股份	55,600	1,591,828.00	0.84
3	002292	奥飞动漫	46,679	1,377,030.50	0.72
4	603288	海天味业	31,900	1,274,405.00	0.67
5	002572	索菲亚	58,087	1,243,061.80	0.65

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。
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。
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。
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申明本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	65,622.43
2	应收证券清算款	8,613,608.14
3	应收股利	-
4	应收利息	2,847.53
5	应收申购款	965,585.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,647,663.45

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

金额单位:人民币元

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	600428	中远航运	3,001,600.00	1.58	筹划重大事项
2	300144	宋城演艺	2,340,324.00	1.23	筹划重大事项

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	167,838,691.47
报告期期间基金总申购份额	79,734,954.77
减:报告期期间基金总赎回份额	119,164,645.34
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	128,409,000.90

§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	3,333.00
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	3,333.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

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
2015年01月21日

富国强收益定期开放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:中国建设银行股份有限公司
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。
基金托管人中国建设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	162,469,876.04	
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	
下属分级基金的基金简称	富国强收益定期开放债券A/B	富国强收益定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	100070	100071
报告期末下属分级基金的份额总额(单位:份)	109,708,096.93	52,761,779.11

§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	3,416,749.33	1,555,785.23
2.本期利润	2,792,946.72	1,263,294.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0254	0.0238
4.期末基金资产净值	121,979,215.88	58,016,488.83
5.期末基金份额净值	1.112	1.100

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	2.30%	0.25%	0.87%	0.01%	1.43%	0.24%

(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	2.23%	0.25%	0.87%	0.01%	1.36%	0.24%

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强收益定期开放债券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强收益定期开放债券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2012年12月18日成立,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		
邹卉	本基金基金经理兼任富国新天锋定期开放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、富国信用债债券型证券投资基金基金经理、富国恒利分级债券型证券投资基金基金经理、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金基金经理	2013-12-23	-	9年	硕士,曾任上海国泰人寿保险有限公司投资部投资助理,东方基金管理有限公司债券研究员,自2008年9月至2011年7月任富国基金管理有限公司债券研究员,自2011年8月至2014年8月任富国天时货币市场基金基金经理,2012年5月起任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理,2012年11月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理,2013年6月起任富国信用债债券型证券投资基金基金经理,2013年12月起任富国强收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,2014年3月起任富国恒利分级债券型证券投资基金基金经理,2014年7月起任富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金基金经理,2014年10月起任富国收益增强债券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	2012-12-18	2014-11-01	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。
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2014年四季度宏观经济仍然在底部运行,信贷增速等数据显示经济下行压力仍较大,食品和原油价格下行情况下,通胀继续低位徘徊。货币政策方面,央行仍然延续了整体宽松的基调,继续采用SLF等货币政策工具以维持流动性稳定性,避免出现系统性风险。四季度资金面总体维持宽松状态,但随着新股发行的加速,以及季末时期仍有阶段性资金紧张。
本季度,基金管理人严格按照基金合同进行投资管理。在本季度前两个月,债券收益继续大幅度走低,直至季度末,考虑到权益市场走强的负面影响,以及新股发行对资金利率的冲击,杠杆价值降低,在操作上总体进行了减仓操作,主要减仓品种为长久期品种。受到中证登关于城投类债券在质押比例上的新规冲击,债券收益率在本季度末出现快速上行,由于之前的减仓策略,本季度较好的控制了各组合收益率回撤风险。
展望2015的债券市场,由于2014四季度的债券收益率调整,又打开了新的投资空间,当前债券收益率仍有一定价值。但2015全年来看,债券收益率下行空间预计有限,操作上预计以持有票息收入为主。
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A/B级2.30%、C级2.23%;同期业绩比较基准收益率A/B级0.87%、C级0.87%。
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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	148,012,251.70	74.08
	其中:债券	148,012,251.70	74.08
	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	29,000,000.00	14.51
	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	17,796,502.35	8.91
7	其他资产	4,989,218.39	2.50
8	合计	199,797,972.44	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投资。
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	107,592,251.70	59.77
5	企业短期融资券	40,420,000.00	22.46
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	148,012,251.70	82.23

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	122618	12沈众债	300,000	30,954,000.00	17.20
2	124007	12西电梯	300,000	30,888,000.00	17.16
3	041455003	14金隅CP001	200,000	20,246,000.00	11.25
4	041461005	14西基投CP001	200,000	20,174,000.00	11.21
5	122981	09铜城投	106,550	10,597,463.00	5.89

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申明本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。
5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,184.86
2	应收证券清算款	261,278.83
3	应收股利	-
4	应收利息	4,719,754.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,989,218.39

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
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	112,774,951.94	56,018,336.90
报告期期间基金总申购份额	16,418.24	42,553.19
减:报告期期间基金总赎回份额	3,083,273.25	3,299,110.98
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	109,708,096.93	52,761,779.11

§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 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人2014年11月03日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

§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
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

富国低碳环保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: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)	326,680,936.53
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(2014年10月01日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	17,565,993.19
2.本期利润	-29,865,811.72
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1071
4.期末基金资产净值	380,315,348.58
5.期末基金份额净值	1.164

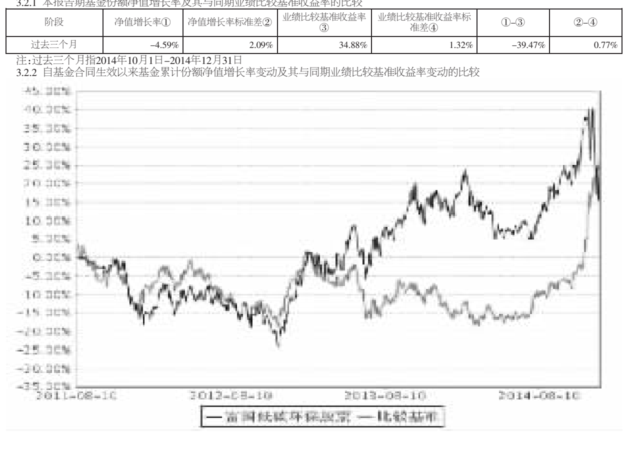
注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-4.59%	2.09%	34.88%	1.32%	-39.47%	0.77%

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		
魏伟	本基金基金经理	2014-07-29	-	9年	硕士,曾任华富基金管理有限公司行业研究员;农银汇理基金管理有限公司研究员、高级研究员、基金经理助理、基金经理;2014年3月加入富国基金管理有限公司,2014年7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

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4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运作分析
4季度宏观经济整体表现较弱,为对冲经济的下滑压力,政府加大了货币和财政政策的力度,在11月中下旬进行了降息,同时2015年基建投资加快的预期开始增强,地产限购限贷放松,同时政府加大改革和走出去的战略,增加微观经济活力,随着一系列政策的出台,预计未来经济将逐步企稳。海外美国较好的宏观数据引发了对美联储加息的预期,引发了美国股市和大宗商品的波动,未来美联储加息的节奏对新兴市场的影响是需要重点关注的,2015年本基金的策略是加强宏观经济和具体公司的研究,寻找确定性较强的机会,配置基本面较优质的个股。
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-4.59%,同期业绩比较基准收益率为34.88%。
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	357,732,977.45	91.94
	其中:股票	357,732,977.45	91.94
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	23,687,555.21	6.09
7	其他资产	7,685,238.39	1.98
8	合计	389,105,771.05	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	177,292,730.16	46.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,288.00	0.00
F	批发和零售业	1,634.00	0.00
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	127,591,591.87	33.55
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	26,667,884.94	7.01
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	3,689,293.08	0.97
S	综合	22,483,555.40	5.91
	合计	357,732,977.45	94.06

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	002568	百润股份	676,837	27,560,802.64	7.25
2	300178	腾邦国际	1,010,913	26,667,884.94	7.01
3	002488	金固股份	1,033,456	24,120,863.04	6.34
4	300295	三六五网	302,821	22,953,831.80	6.04
5	600212	江泉实业	2,741,897	22,483,555.40	5.91
6	300226	上海钢联	348,841	21,059,531.17	5.54
7	300104	乐视网	643,400	20,871,896.00	5.49
8	300059	东方财富	735,643	20,568,578.28	5.41
9	002446	盛路通信	600,722	18,015,652.78	4.74
10	000153	丰原药业	1,221,437	15,084,746.95	3.97

5.4 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。
5.5 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
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申明本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	245,724.70
2	应收证券清算款	2,644,761.13
3	应收股利	-
4	应收利息	6,763.91
5	应收申购款	4,787,988.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,685,238.39

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
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

报告期期初基金份额总额	270,624,187.97
报告期期间基金总申购份额	179,726,661.75
减:报告期期间基金总赎回份额	123,669,913.19
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	326,680,936.53

§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
2015年01月21日