富国医疗保健行业股票型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3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04月20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4月16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2015年1月1日起至2015年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国医疗保健行业股票
基金主代码	000220
交易代码	000220
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年08月07日
报告期末基金份额总额 单位:份)	267,764,509.35
投资目标	本基金主要投资于医疗保健行业股票,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	中证医药卫生指数收益率×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	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(2015年01月01日-2015年03月31日)
1.本期已实现收益	116,584,645.32
2.本期利润	137,992,539.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.4477
4.期末基金资产净值	493,437,899.66
5.期末基金份额净值	1.843

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	33.07%	2.05%	23.58%	0.99%	9.49%	1.06%

注:过去三个月指2015年1月1日—2015年3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2015年3月31日。

本基金于2013年08月07日成立,本基金建仓期6个月,即从2013年08月07日至2014年02月06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		
戴益强	本基金基金经理兼任汉兴证券投资基金基金经理	2013-08-07	-	8年	硕士,曾任易方达基金管理有限公司行业研究员;2008年9月至2012年10月任富国基金管理有限公司行业研究员,2012年10月至2014年1月任汉盛证券投资基金基金经理,2013年8月起任富国医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理,2014年1月起任汉兴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医疗保健行业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》、《富国医疗保健行业股票型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,以尽可能减少和分散投资风险,力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标,管理和运用基金资产,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2次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内本基金的投资策略和运作分析

一季度医药行业的主要变化在一些地区的药品招标和与互联网技术结合的医疗领域的蓬勃发展。我们试图抓住上述的医疗行业投资主线,适度集中到新兴技术领域和互联网医疗的个股中,希望为投资者取得超额收益。

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33.07%,同期业绩比较基准收益率为23.58%。

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	445,941,597.77	66.54
	其中:股票	445,941,597.77	66.54
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	104,400,216.22	15.58
7	其他资产	119,826,920.84	17.88
8	合计	670,168,734.83	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	323,891,880.25	65.64
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	22,276.72	-
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	95,031,346.12	19.26
J	金融业	-	-
K	房地产业	21,311,263.35	4.32
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,797,451.33	0.77
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	1,887,380.00	0.38
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	445,941,597.77	90.37

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	300253	卫宁软件	302,225	49,292,897.50	9.99
2	300341	麦迪电气	2,104,500	47,772,150.00	9.68
3	300109	新开源	1,083,528	47,458,526.40	9.62
4	300016	北陆药业	1,879,541	47,364,433.20	9.60
5	300272	开能环保	1,454,284	35,048,244.40	7.10
6	002568	百润股份	409,412	32,814,371.80	6.65
7	300059	东方财富	1,081,781	31,825,997.02	6.45
8	300151	昌红科技	918,093	25,109,843.55	5.09
9	300086	康芝药业	1,369,665	24,955,296.30	5.06
10	000782	美达股份	1,750,300	24,539,206.00	4.97

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

本基金投资股指期货特别根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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,本基金持有的康芝药业发行主体海南康芝药业股份有限公司于2014年7月1日公告收到中国证监会海南监管局行政处罚决定书(2014]2号),并公告接受中国证券监督管理委员会海南监管局的行政处罚,不申请行政复议和提起行政诉讼,将在规定时间内缴纳罚款。深圳证券交易所于2014年8月18日发布《关于对海南康芝药业股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》,海南康芝药业股份有限公司2011年年度报告的财务信息存在重大会计差错,相关当事人未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务,深圳证券交易所决定给予通报批评处分。

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	2,146,838.35
2	应收证券清算款	117,661,093.92
3	应收股利	-
4	应收利息	18,988.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,826,920.84

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	300059	东方财富	31,825,997.02	6.45	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	347,329,456.83
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	79,564,947.48
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	267,764,509.35

§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医疗保健行业股票型证券投资基金的文件

2、富国医疗保健行业股票型证券投资基金基金合同

3、富国医疗保健行业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、富国医疗保健行业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、40088880688(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04月20日

富国低碳环保股票型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3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04月20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4月16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2015年1月1日起至2015年3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)	2,800,815,817.23
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(2015年01月01日-2015年03月31日)
1.本期已实现收益	52,464,715.39
2.本期利润	1,161,383,991.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.9863
4.期末基金资产净值	6,121,437,914.11
5.期末基金份额净值	2.186

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。

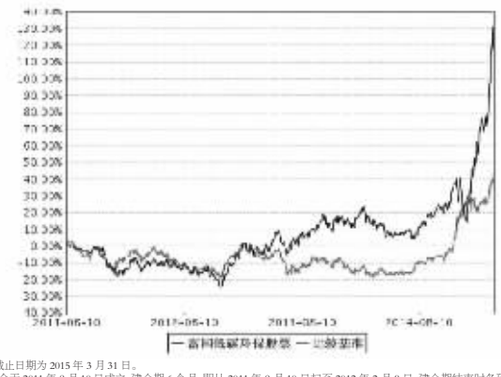
3.2 基金净值表现

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	87.80%	2.62%	11.89%	1.46%	75.91%	1.16%

注:过去三个月指2015年1月1日—2015年3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2015年3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	本基金基金经理兼任富国新兴产业股票型证券投资基金基金经理	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,2015年3月起兼任富国新兴产业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,力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标,管理和运用基金资产,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6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 报告期内本基金的投资策略和运作分析

2015年1季度宏观经济依然比较低迷,央行进行了降准和降息,市场流动性比较宽松,新兴产业板块经过2014年底的充分调整,在2015一季度表现较好,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87.8%,同期业绩比较基准收益率为11.89%。

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	5,751,094,537.11	86.97
	其中:股票	5,751,094,537.11	86.97
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	707,543,806.32	10.70
7	其他资产	154,187,379.94	2.33
8	合计	6,612,825,723.37	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	2,578,439,210.79	42.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,754.00	-
F	批发和零售业	9,598.00	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,703.00	-
H	住宿和餐饮业	3,896.15	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,555,378,675.60	41.74
J	金融业	-	-
K	房地产业	6,069.00	-
L	租赁和商务服务业	550,957,091.77	9.00
M	科学研究和技术服务业	13,206.00	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,334.00	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,791.00	-
Q	卫生和社会工作	9,307,942.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	56,940,265.80	0.93
S	综合	-	-
	合计	5,751,094,537.11	93.95

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	300104	乐视网	5,151,877	482,833,912.44	7.89
2	002280	联络互动	3,180,056	451,249,946.40	7.37
3	300178	腾邦国际	7,099,758	443,521,882.26	7.25
4	002488	金固股份	8,651,111	437,746,216.60	7.15
5	002496	辉丰股份	14,020,267	435,749,898.36	7.12
6	300295	三六五网	2,436,268	421,693,628.12	6.89
7	300253	卫宁软件	2,101,141	342,696,097.10	5.60
8	300226	上海钢联	2,676,537	311,013,599.40	5.08
9	002363	隆基机械	9,638,029	310,826,435.25	5.08
10	002568	百润股份	3,670,487	294,189,533.05	4.81

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没有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	718,387.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	186,019.49
5	应收申购款	153,282,972.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	154,187,379.94

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	002280	联络互动	451,249,946.40	7.37	筹划重大事项
2	002496	辉丰股份	58,098,900.72	0.95	配股未上市流通

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	326,680,936.53
报告期期间基金总申购份额	4,355,885,596.61
减:报告期期间基金总赎回份额	1,881,750,715.91
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	2,800,815,817.23

§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、40088880688(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04月20日

富国创业板指数分级证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3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04月20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4月16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2015年1月1日起至2015年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国创业板指数分级
场内简称	富国创业(现名:创业分级)
基金主代码	161022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年09月12日
报告期末基金份额总额	3,127,903,083.08
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪创业板指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资,依托富国量化投资平台,利用长期稳定的风险模型和交易成本模型,按照成份股在创业板指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪创业板指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
业绩比较基准	95%×创业板指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。
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	创业板A	创业板B	富国创业板指数分级
下属分级基金场内简称	创业板A	创业板B	富国创业(现名:创业分级)
下属分级基金的交易代码	150152	150153	161022
报告期末下属分级基金的份额总额(单位:份)	1,301,499,560.00	1,301,499,561.00	524,903,962.08
下属分级基金的风险收益特征	富国创业板A份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	富国创业板B份额具有高风险、高预期收益的特征。	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。

注:根据《富国基金管理有限公司关于旗下部分指数证券投资基金变更场内简称的公告》,富国创业板指数分级证券投资基金自2015年4月13日起变更基础份额的场内简称(交易代码不变),场内简称由“富国创业”变更为“创业分级”。

§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(2015年01月01日-2015年03月31日)
1.本期已实现收益	879,660,436.33
2.本期利润	1,642,683,897.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.4558
4.期末基金资产净值	3,114,682,997.42
5.期末基金份额净值	0.996

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