富国低碳环保混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015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
送出日期:2016年03月26日

§1 重要提示及目录

1.1重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2016年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

1.2

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	富国低碳环保混合
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
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
报告期末基金份额总额	2,927,765,507.37份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

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	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	沈炜男	张燕
	联系电话	021-20361818	0755-83199084
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105686,4008880688	95555
传真		021-20361616	0755-83195201

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司:上海市浦东新区世纪大道8号;上海国金中心二期16、17层 招商银行股份有限公司:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	2,050,212,160.37	41,328,881.05	126,096,364.88
本期利润	3,152,910,930.19	-17,510,884.95	143,422,568.21
加权平均基金份额本期利润	1.4040	-0.0481	0.2365
本期基金份额净值增长率	163.06%	0.17%	29.69%
3.1.2期末数据和指标	2015年12月31日	2014年12月31日	2013年12月31日
期末可供分配基金份额利润	1.1714	0.1187	0.0359
期末基金资产净值	8,964,167,181.29	380,315,348.58	611,692,471.47
期末基金份额净值	3.062	1.164	1.362

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,封闭式基金交易佣金、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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	20.08%	1.48%	13.75%	1.34%	6.33%	0.11%
过去六个月	1.06%	1.73%	-12.03%	2.14%	13.09%	-0.41%
过去一年	163.06%	2.30%	7.41%	1.99%	155.65%	0.31%
过去三年	241.74%	1.76%	44.24%	1.43%	197.50%	0.33%
自基金合同生效以来至今	206.20%	1.58%	35.53%	1.32%	170.67%	0.26%

注:根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定,本基金业绩比较基准=沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

本基金权益类证券投资部分、固定收益类证券投资部分的业绩比较基准分别采用具有代表性的沪深300指数和中债综合指数。

本基金每个交易日过去业绩比较基准进行再平衡处理,日收益率(benchmark)按下列公式计算:

benchmark t = 80%* [沪深300指数t/(沪深300指数t-1)-1] +20%* [中债综合指数t/中债综合指数t-1)-1];

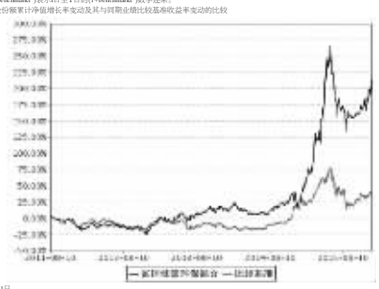
其中,t=1,2,3,…,T,T表示时间跨度至日;

期间T日收益率(benchmark T)按下列公式计算:

benchmark T =[∏(t=1)^T(1+benchmark t)-1

其中,T=2,3,4,…; ∏(t=1)^T(1+benchmark t)表示自t至T日的(1+benchmark t)数字连乘。

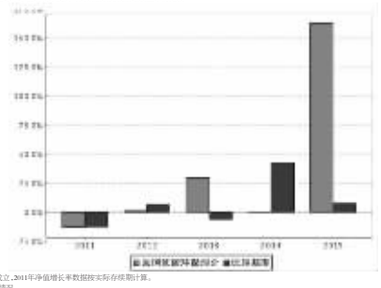
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.截止日期为2015年12月31日。

2.本基金于2011年8月10日成立,本基金建仓期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。

3.2.3自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1.本基金于2011年8月10日成立,2011年净值增长率数据按实际存续情况计算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	—	—	—	—	—
2014年	—	—	—	—	—
2013年	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

注:过往三年本基金未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1基金管理人及基金经理

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于1999年4月13日获国家工商行政管理局登记注册成立,是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一,公司于2001年3月从北京迁址上海,2003年9月加入全国社保基金投资管理(AMC)。作为富国基金管理有限公司的子公司,富国基金管理香港有限公司的子公司,第一家中外合资的基金管理公司,截至2015年12月31日,本基金管理人共管理富国天惠灵活配置混合型证券投资基金、富国消费主题混合型证券投资基金、富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值混合型证券投资基金、富国天添利货币市场基金、富国天瑞强势城镇化精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选混合型证券投资基金、富国天博创新主题混合型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金(LOF)、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国庆元增强债券型证券投资基金、富国沪深300指数增强型证券投资基金、富国低碳环保混合型证券投资基金、富国天利回报分级债券型证券投资基金、富国全球资产配置混合型证券投资基金、富国天鑫股票型证券投资基金、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国天添益债券型证券投资基金(LOF)、富国全球顶级消费品混合型证券投资基金、富国低碳环保混合型证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国中证中小盘价值主题指数证券投资基金、富国天成混合型证券投资基金、富国纯债分级债券型证券投资基金、富国天益深证成指分级证券投资基金、富国天策瑞奇灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠沪港深灵活配置混合型证券投资基金、富国天盈灵活配置混合型证券投资基金、富国天利短债债券型证券投资基金、富国天添利定期开放债券型证券投资基金、富国天益沪港深灵活配置混合型证券投资基金、富国天利增长两年期债券型证券投资基金、富国天惠灵活配置混合型证券投资基金、富国天利灵活配置混合型证券投资基金、富国天利中证500指数增强型证券投资基金、富国天利灵活配置混合型证券投资基金、富国天利定期开放债券型证券投资基金、富国天利灵活配置混合型证券投资基金、富国天利灵活配置混合型证券投资基金、富国天利灵活配置混合