

富国低碳环保股票型证券投资基金

【2014】第四季度报告

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	在本基金的投资期限	证券从业年限	说明
刘波	本基金基金经理	2014-08-29	9年	硕士,曾任华夏基金管理有限公司研究员;农银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,无损害基金份额持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3公平交易专项说明
4.3.1公平交易原则的执行情况
本基金管理人根据相关法律法规,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、二级市场交易的相关研究分析、投资决策、授权执行、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似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一反向交易类别为限制行为,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交易公平性进行自动化处理。2、同一基金投资组合的不同组合,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资产的组合。
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、通过公平交易的事后分析评估系统,对涉及公平交易的交易行为进行分析评估,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、不同产品之间以及同一基金投资组合内不同组合的交易行为,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解释,并按要求上报相关监管机构;2、季度公平性交易分析按规定经基金经理审核、并经督察长、总经理审阅签字后,归档保存,以备后查。

本报告期末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。
公司旗下管理的投资组合在交易所公开竞价间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次间日反向交易或交易成本较高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,为对冲经济下的滑压力,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年在稳增长加快的预期开始驱动,地产消费股被炒,同时供给侧改革,通胀和走出去的战略,增加刺激经济活力,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波动,未来美联储加息的矛头对新兴市场的影响是需要重点关注的,2015年本基金的投资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,配置基本盘优质个股。
4.5报告期内基金的业绩表现
本基金报告期内净值增长率为-4.50%,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人数或基金资产净值预警情形的说明
本报告期无需说明的相关情况。

§ 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)	占基金资产的比例(%)	
1	固定收益投资	419,804,379.09	39.15	
	其中:债券	419,804,379.09	39.15	
	资产支持证券	-	-	
2	买入返售金融资产	169,851,014.78	15.84	
	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	466,928,800.69	43.55	
4	其他资产	15,681,073.05	1.46	
5	合计	1,072,265,267.61	100.00	

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合				
序号	行业名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	农林、牧、渔	676,837	27,560,802.64	7.25
2	采矿业	1,010,013	26,627,884.94	7.01
3	制造业	1,033,456	24,120,863.64	6.54
4	建筑业	302,821	22,953,831.80	6.04
5	电力、热力、燃气及水生产和供应业	274,197	22,483,555.40	5.91
6	交通运输、仓储和邮政业	348,841	21,059,531.17	5.54
7	信息技术、软件和信息技术服务业	643,400	20,871,896.00	5.49
8	金融业	735,643	20,568,578.28	5.41
9	房地产业	600,722	18,015,652.78	4.74
10	综合	1,221,437	15,084,746.95	3.97

5.4报告期末按债券品种和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资产。
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

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)
1	002568	西药股份	676,837	27,560,802.64
2	300178	腾信股份	1,010,013	26,627,884.94
3	002488	金固股份	1,033,456	24,120,863.64
4	300295	六国化工	302,821	22,953,831.80
5	000212	广合股份	274,197	22,483,555.40
6	300226	华翔新材	348,841	21,059,531.17
7	300104	乐视网	643,400	20,871,896.00
8	300059	东方财富	735,643	20,568,578.28
9	002446	荣信股份	600,722	18,015,652.78
10	000553	招商局	1,221,437	15,084,746.95

5.10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权证投资明细				
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)
1	002568	西药股份	676,837	27,560,802.64
2	300178	腾信股份	1,010,013	26,627,884.94
3	002488	金固股份	1,033,456	24,120,863.64
4	300295	六国化工	302,821	22,953,831.80
5	000212	广合股份	274,197	22,483,555.40
6	300226	华翔新材	348,841	21,059,531.17
7	300104	乐视网	643,400	20,871,896.00
8	300059	东方财富	735,643	20,568,578.28
9	002446	荣信股份	600,722	18,015,652.78
10	000553	招商局	1,221,437	15,084,746.95

5.11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权证投资明细				
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)
1	002568	西药股份	676,837	27,560,802.64
2	300178	腾信股份	1,010,013	26,627,884.94
3	002488	金固股份	1,033,456	24,120,863.64
4	300295	六国化工	302,821	22,953,831.80
5	000212	广合股份	274,197	22,483,555.40
6	300226	华翔新材	348,841	21,059,531.17
7	300104	乐视网	643,400	20,871,896.00
8	300059	东方财富	735,643	20,568,578.28
9	002446	荣信股份	600,722	18,015,652.78
10	000553	招商局	1,221,437	15,084,746.95

5.12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权证投资明细				
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)
1	002568	西药股份	676,837	27,560,802.64
2	300178	腾信股份	1,010,013	26,627,884.94
3	002488	金固股份	1,033,456	24,120,863.64
4	300295	六国化工	302,821	22,953,831.80
5	000212	广合股份	274,197	22,483,555.40
6	300226	华翔新材	348,841	21,059,531.17
7	300104	乐视网	643,400	20,871,896.00
8	300059	东方财富	735,643	20,568,578.28
9	002446	荣信股份	600,722	18,015,652.78
10	000553	招商局	1,221,437	15,084,746.95

5.13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权证投资明细				
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)
1	002568	西药股份	676,837	27,560,802.64
2	300178	腾信股份	1,010,013	26,627,884.94
3	002488	金固股份	1,033,456	24,120,863.64
4	300295	六国化工	302,821	22,953,831.80
5	000212	广合股份	274,197	22,483,555.40
6	300226	华翔新材	348,841	21,059,531.17
7	300104	乐视网	643,400	20,871,896.00
8	300059	东方财富	735,643	20,568,578.28
9	002446	荣信股份	600,722	18,015,652.78
10	000553	招商局	1,221,437	15,084,746.95

5.14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权证投资明细				
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)
1	002568	西药股份	676,837	27,560,802.64
2	300178	腾信股份	1,010,013	26,627,884.94
3	002488	金固股份	1,033,456	24,120,863.64
4	300295	六国化工	302,821	22,953,831.80
5	000212	广合股份	274,197	22,483,555.40
6	300226	华翔新材	348,841	21,059,531.17
7	300104	乐视网	643,400	20,871,896.00
8	300059	东方财富	735,643	20,568,578.28
9	002446	荣信股份	600,722	18,015,652.78
10	000553	招商局	1,221,437	15,084,746.95

5.15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权证投资明细				
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)
1	002568	西药股份	676,837	27,560,802.64
2	300178	腾信股份	1,010,013	26,627,884.94
3	002488	金固股份	1,033,456	24,120,863.64
4	300295	六国化工	302,821	22,953,831.80
5	000212	广合股份	274,197	22,483,555.40
6	300226	华翔新材	348,841	21,059,531.17
7	300104	乐视网	643,400	20,871,896.00
8	300059	东方财富	735,643	20,568,578.28
9	002446	荣信股份	600,722	18,015,652.78
10	000553	招商局	1,221,437	15,084,746.95

5.16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权证投资明细				
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)
1	002568	西药股份	676,837	27,560,802.64
2	300178	腾信股份	1,010,013	26,627,884.94
3	002488	金固股份	1,033,456	24,120,863.64
4	300295	六国化工	302,821	22,953,831.80
5	000212	广合股份	274,197	22,483,555.40
6	300226	华翔新材	348,841	21,059,531.17
7	300104	乐视网	643,400	20,871,896.00
8	300059	东方财富	735,643	20,568,578.28
9	002446	荣信股份	600,722	18,015,652.78
10	000553	招商局	1,221,437	15,084,746.95

5.17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权证投资明细				
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)
1	002568	西药股份	676,837	27,560,802.64
2	300178	腾信股份	1,010,013	26,627,884.94
3	002488	金固股份	1,033,456	24,120,863.64
4	300295	六国化工	302,821	22,953,831.80
5	000212	广合股份	274,197	22,483,555.40
6	300226	华翔新材	348,841	21,059,531.17
7	300104	乐视网	643,400	20,871,896.00
8	300059	东方财富	735,643	20,568,578.28
9	002446	荣信股份	600,722	18,015,652.78
10	000553	招商局	1,221,437	15,084,746.95

5.18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权证投资明细				
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)
1	002568	西药股份	676,837	27,560,802.64
2	300178	腾信股份	1,010,013	26,627,884.94
3	002488	金固股份	1,033,456	24,120,863.64
4	300295	六国化工	302,821	22,953,831.80
5	000212	广合股份	274,197	22,483,555.40
6	300226	华翔新材	348,841	21,059,531.17
7	300104	乐视网	643,400	20,871,896.00
8	300059	东方财富	735,643	20,568,578.28
9	002446	荣信股份	600,722	18,015,652.78
10	000553	招商局	1,221,437	15,084,746.95

富国基金管理有限公司
2015年01月21日

富国高端制造行业股票型证券投资基金

【2014】第四季度报告

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	在本基金的投资期限	证券从业年限	说明
陆天华	本基金基金经理	2014-06-20	15年	硕士,曾任中国南方证券有限公司汽车按揭部助理,中国北方工业资产管理有限责任公司研究员,2002年3月任富国基金管理有限公司基金经理助理,2007年4月至今任富国高端制造行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高端制造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》、《富国高端制造行业股票型证券投资基金合同》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,无损害基金份额持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3公平交易专项说明
4.3.1公平交易原则的执行情况
本基金管理人根据相关法律法规,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、二级市场交易的相关研究分析、投资决策、授权执行、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似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一反向交易类别为限制行为,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交易公平性进行自动化处理。2、同一基金投资组合的不同组合,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资产的组合。
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、通过公平交易的事后分析评估系统,对涉及公平交易的交易行为进行分析评估,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、不同产品之间以及同一基金投资组合内不同组合的交易行为,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解释,并按要求上报相关监管机构;2、季度公平性交易分析按规定经基金经理审核、并经督察长、总经理审阅签字后,归档保存,以备后查。

本报告期末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。
公司旗下管理的投资组合在交易所公开竞价间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次间日反向交易或交易成本较高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,为对冲经济下的滑压力,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年在稳增长加快的预期开始驱动,地产消费股被炒,同时供给侧改革,通胀和走出去的战略,增加刺激经济活力,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波动,未来美联储加息的矛头对新兴市场的影响是需要重点关注的,2015年本基金的投资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,配置基本盘优质个股。
4.5报告期内基金的业绩表现
本基金报告期内净值增长率为-1.95%,同期业绩比较基准收益率为26.71%。
4.6报告期内管理人对本基金持有人人数或基金资产净值预警情形的说明
本报告期无需说明的相关情况。

§ 5 投资组合报告