

信息披露 Disclosure

富国沪深300增强证券投资基金

2014 年度 报告 摘要

了四季度的市场也快速反弹上地。沪深300指数在整体上上涨1.66%。

截至2015年,我们沪深300增强证券投资基金业绩表现良好,但随着资产配置调整进入中后期,市场上涨幅会较四季度有明显回落,指数的波动肯定会上升。二季度是经济数据公布的敏感时期,需要密切关注经济数据持续不佳打击投资者情绪的风险,由此带动及投资者行为基于“避险”的冲动,一旦出现调整,其幅度可能会相对较大。

4.6 管理人对本报告期内基金估值程序等事项的说明
本公司按照相关法律法规的规定建立了估值委员会,并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司估值的主要决策机关,由主管运营副总经理负责,成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理,所有相关成员均具有丰富的证券投资基金从业经验。公司估值委员会负责提供估值意见,提供和评估估值技术,执行估值决策程序,对外信息披露等工作,保证基金估值的公允性和合理性,维护基金持有人的利益。基金估值委员会成员的重要组成,必须向估值委员会的定期会议,提出基金估值技术和估值技术中存在的问题,参与估值程序和技术决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
根据相关法律法规,本基金《基金合同》约定以及基金的实际运作情况,2014报告期内本基金未发生估值程序分配事件,也不存在估值程序。本基金严格按照法律法规及基金合同约定进行估值分配。

4.8 报告期内管理人对于本基金持有或投资资产估值程序等事项的说明
本报告期内需要说明的相关情形。

5 托管人报告
报告期内本基金托管人严格按照《信托法》、《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对于报告期内基金投资运作遵规守法、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内,富国沪深300增强证券投资基金的托管人——中国工商银行股份有限公司在富国沪深300增强股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的有关规定进行。本报告期内,富国沪深300增强股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对报告期内基金投资信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国沪深300增强股票型证券投资基金2014年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部
2015年3月28日

6 审计报告
本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

7 年度财务报表
会计主体:富国沪深300增强证券投资基金
报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资产

项目

3.1 主要会计数据和财务指标

单位:人民币元

注:上述基金业绩指标不包括持有认购或申购基金份额的各项费用(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。

本报告期内实现基金净收入、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 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为2014年12月31日。

2.本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6月15日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:上述三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1.截至日期为20