

信息披露 Disclosure

富国中小盘精选混合型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

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：2016年01月20日

§ 1 重要提示

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。本基金于2016年1月10日披露了本基金中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证定期报告内不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理保证本人履行职责期间遵守行业规范，没有从事违法违规行为，没有利用基金财产谋取非法利益。

本报告财务资料未经审计。

本报告期末2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 富国中小盘精选混合

基金代码 000040

前端交易代码 000040
后端交易代码 000041

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2015年01月02日

报告期末基金份额总额(单位：份) 1,200,710,068.07

报告目标 本基金主要通过投资于股票市场中具有较高成长性的中小股票，追求基金资产的长期增值。

本基金主要通过以下自下而上相结合的方式进行主动管理：以数据驱动和量化研究为基础，分析行业和个股的内在价值，结合估值水平，精选质地优秀的公司，进行自下而上的资产配置和组合构建，从而更好的执行买入持有的投资策略，具有良好合理的结构。

业绩比较基准 中证中小板指数收益率*60%+中证新发债信用债指数收益率*20%

风险收益特征 本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、低风险基金，属于中高风险收益类理财产品。

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

§ 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10月01日-2015年12月31日)

1.本期已实现收益 304,764,327.59

2.本期利润 485,171,327.36

3.期末可供分配基金份额利润 0.0561

4.期末基金资产净值 1,809,066,967.06

5.期末基金份额净值 1.466

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

序号 阶段 业绩报酬率(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差差值(%) ①-③ ②-④

过去三个月 36.65% 2.36% 2.36% 16.11% 36.09% 0.04%

注：过去三个季度指2015年10月1日—2015年12月31日。

本基金于2015年1月22日成立，自合同生效之日起至本报告期末不足一年。

本基金于2015年1月22日成立，建仓期4个月，从2015年1月23日至2015年7月22日，建仓结束时各项资产比例均符合基金合同的约定。

§ 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 离任日期 说明

曹晋 本基金基金经理 经理、富国中小盘精选混合型证券投资基金基金经理 2015-01-23 - 6年 哈工大工学硕士，2000年加入富国基金管理有限公司，2015年1月起兼任富国中小盘精选混合型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格，具有丰富的证券从业经验，过往管理的基金业绩良好，具备良好的职业操守。

注：上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；曾任基金经理期间的解聘日期、曾任基金经理期间的公司名称、离任日期、离任原因等信息请参见定期报告。

2.证券从业的人员必须遵纪守法，具有良好的职业道德。

3.基金经理的过往业绩并不代表其未来表现，投资者在做出投资决策前应仔细阅读该基金经理的简历。

4.报告期内，富国基金管理有限公司作为旗下中小盘精选混合型证券投资基金的基金管理人，严格按照相关法律法规的规定，履行了法定的报告、信息披露、资产估值、投资决策、交易监控、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。

5.事前控制主要包括：1、严格执行止损线；2、二级市场通过交易系统的资金准备、交易手续及授权管理，对投资标的、交易对手等进行严格控制；3、通过事前评估和同级会商，对相关事项进行合理性评价，按法律要求上报相关部门，对同一事项的评估相同或相似的决策，必须通过交易系统采取同一组合下达投资指令，确保公平对待其组合的交易机会。

6.事后评估及反馈主要包括结合同级止损线的执行情况、向后反溯的合理性分析、对后反溯的合理性分析等，通过事前评估和同级会商，以及对后反溯的合理性分析等，对投资标的、交易对手等进行严格控制；4、通过事前评估和同级会商，对相关事项进行合理性评价，按法律要求上报相关部门，对同一事项的评估相同或相似的决策，必须通过交易系统采取同一组合下达投资指令，确保公平对待其组合的交易机会。

7.公平交易制度的执行情况参见“公平交易制度的执行情况”部分。

8.报告期内基金经理的个人行为不存在损害基金持有人利益的行为。

§ 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 1,327,241,026.38 69.89

其中：股票 1,327,241,026.38 69.89

2 固定收益投资 - -

其中：债券 - -

资产支持证券 - -

3 货币市场投资 - -

4 金融衍生品投资 - -

5 其他资产 1,046,820,260.00 24.86

6 衍生工具及权证投资合计 472,104,319.76 24.86

7 其他资产 99,741,543.79 5.25

8 合计 1,890,096,899.02 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 本报告期内股票投资组合

5.2.2 本报告期内股票投资组合

5.2.3 本报告期内股票投资组合

5.2.4 本报告期内股票投资组合

5.2.5 本报告期内股票投资组合

5.2.6 本报告期内股票投资组合

5.2.7 本报告期内股票投资组合

5.2.8 本报告期内股票投资组合

5.2.9 本报告期内股票投资组合

5.2.10 本报告期内股票投资组合

5.2.11 本报告期内股票投资组合

5.2.12 本报告期内股票投资组合

5.2.13 本报告期内股票投资组合

5.2.14 本报告期内股票投资组合

5.2.15 本报告期内股票投资组合

5.2.16 本报告期内股票投资组合

5.2.17 本报告期内股票投资组合

5.2.18 本报告期内股票投资组合

5.2.19 本报告期内股票投资组合

5.2.20 本报告期内股票投资组合

5.2.21 本报告期内股票投资组合

5.2.22 本报告期内股票投资组合

5.2.23 本报告期内股票投资组合

5.2.24 本报告期内股票投资组合

5.2.25 本报告期内股票投资组合

5.2.26 本报告期内股票投资组合

5.2.27 本报告期内股票投资组合

5.2.28 本报告期内股票投资组合

5.2.29 本报告期内股票投资组合

5.2.30 本报告期内股票投资组合

5.2.31 本报告期内股票投资组合

5.2.32 本报告期内股票投资组合

5.2.33 本报告期内股票投资组合

5.2.34 本报告期内股票投资组合

5.2.35 本报告期内股票投资组合

5.2.36 本报告期内股票投资组合

5.2.37 本报告期内股票投资组合

5.2.38 本报告期内股票投资组合

5.2.39 本报告期内股票投资组合

5.2.40 本报告期内股票投资组合

5.2.41 本报告期内股票投资组合

5.2.42 本报告期内股票投资组合

5.2.43 本报告期内股票投资组合

5.2.44 本报告期内股票投资组合

5.2.45 本报告期内股票投资组合

5.2.46 本报告期内股票投资组合

5.2.47 本报告期内股票投资组合

5.2.48 本报告期内股票投资组合

5.2.49 本报告期内股票投资组合

5.2.50 本报告期内股票投资组合

5.2.51 本报告期内股票投资组合

5.2.52 本报告期内股票投资组合

5.2.53 本报告期内股票投资组合

5.2.54 本报告期内股票投资组合

5.2.55 本报告期内股票投资组合

5.2.56 本报告期内股票投资组合

5.2.57 本报告期内股票投资组合

5.2.58 本报告期内股票投资组合

5.2.59 本报告期内股票投资组合

5.2.60 本报告期内股票投资组合

5.2.61 本报告期内股票投资组合

5.2.62 本报告期内股票投资组合

5.2.63 本报告期内股票投资组合

5.2.64 本报告期内股票投资组合

5.2.65 本报告期内股票投资组合

5.2.66 本报告期内股票投资组合

5.2.67 本报告期内股票投资组合

5.2.68 本报告期内股票投资组合

5.2.69 本报告期内股票投资组合

5.2.70 本报告期内股票投资组合

5.2.71 本报告期内股票投资组合

5.2.72 本报告期内股票投资组合

5.2.73 本报告期内股票投资组合

5.2.74 本报告期内股票投资组合

5.2.75 本报告期内股票投资组合

5.2.76 本报告期内股票投资组合

5.2.77 本报告期内股票投资组合

5.2.78 本报告期内股票投资组合

5.2.79 本报告期内股票投资组合

5.2.80 本报告期内股票投资组合

5.2.81 本报告期内股票投资组合

5.2.82 本报告期内股票投资组合

5.2.83 本报告期内股票投资组合

5.2.84 本报告期内股票投资组合

5.2.85 本报告期内股票投资组合