

富国强回报定期开放债券型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2016年1月20日

的重要提示

富国基金管理有限公司的董事及董秘将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约定，于2016年1月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

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	权证投资	-	-
其中：股票	-	-	
2	固定收益投资	306,847,996.70	94.24
其中：债券	306,847,996.70	94.24	
货币市场基金	-	-	
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	9,714,676.26	2.99
7	其他资产	8,981,414.23	2.77
8	合计	324,644,080.18	100.00

5.2 报告期内基金的业绩表现

5.2.1 报告期内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

注：本基金业绩比较基准为同行业平均开放式债券型基金的预期收益，其预期风险和预期收益均较低。

5.2.2 报告期各时间段内本基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金业绩比较基准为同行业平均开放式债券型基金的预期收益，其预期风险和预期收益均较低。

5.2.3 报告期未进行份额折算，因此，本期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率无差异。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

5.3.1 主要财务指标

单位：人民币元

A/B级 C/B级

报告期(A)2015年10月01日-2015年12月31日 报告期(B)2015年10月01日-2015年12月31日

1.本期已实现收益 3,096,849.23 2,160,704.11

2.本期利润 2,894,114.80 1,966,037.78

3.报告期基金份额利润 0.0277 0.0247

4.期末基金资产净值 128,644,916.37 92,466,366.70

5.期末基金份额净值 1.268 1.244

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。

5.3.2 报告期净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) A/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.20% 0.08% 0.01% 1.46% 0.07%

(2) C/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.13% 0.07% 0.01% 1.32% 0.06%

注：过去三个季度为2015年10月1日-2015年12月31日。

3.2 报告期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

(1) 自基金合同生效以来富国强回报定期开放债券A/B基金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：本基金业绩比较基准为同行业平均开放式债券型基金的预期收益，其预期风险和预期收益均较低。

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

(1) A/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.20% 0.08% 0.01% 1.46% 0.07%

(2) C/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.13% 0.07% 0.01% 1.32% 0.06%

注：过去三个季度为2015年10月1日-2015年12月31日。

3.2.2 报告期基金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

(1) 自基金合同生效以来富国强回报定期开放债券A/B基金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：本基金业绩比较基准为同行业平均开放式债券型基金的预期收益，其预期风险和预期收益均较低。

3.2.3 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

(1) A/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.20% 0.08% 0.01% 1.46% 0.07%

(2) C/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.13% 0.07% 0.01% 1.32% 0.06%

注：过去三个季度为2015年10月1日-2015年12月31日。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

3.3.1 主要财务指标

单位：人民币元

A/B级 C/B级

报告期(A)2015年10月01日-2015年12月31日 报告期(B)2015年10月01日-2015年12月31日

1.本期已实现收益 3,096,849.23 2,160,704.11

2.本期利润 2,894,114.80 1,966,037.78

3.报告期基金份额利润 0.0277 0.0247

4.期末基金资产净值 128,644,916.37 92,466,366.70

5.期末基金份额净值 1.268 1.244

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。

3.3.2 报告期基金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

(1) 自基金合同生效以来富国强回报定期开放债券C/B基金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：本基金业绩比较基准为同行业平均开放式债券型基金的预期收益，其预期风险和预期收益均较低。

3.3.3 报告期基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) A/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.20% 0.08% 0.01% 1.46% 0.07%

(2) C/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.13% 0.07% 0.01% 1.32% 0.06%

注：过去三个季度为2015年10月1日-2015年12月31日。

3.3.4 报告期基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) A/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.20% 0.08% 0.01% 1.46% 0.07%

(2) C/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.13% 0.07% 0.01% 1.32% 0.06%

注：过去三个季度为2015年10月1日-2015年12月31日。

3.3.5 报告期基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) A/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.20% 0.08% 0.01% 1.46% 0.07%

(2) C/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.13% 0.07% 0.01% 1.32% 0.06%

注：过去三个季度为2015年10月1日-2015年12月31日。

3.3.6 报告期基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) A/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.20% 0.08% 0.01% 1.46% 0.07%

(2) C/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.13% 0.07% 0.01% 1.32% 0.06%

注：过去三个季度为2015年10月1日-2015年12月31日。

3.3.7 报告期基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) A/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.20% 0.08% 0.01% 1.46% 0.07%

(2) C/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.13% 0.07% 0.01% 1.32% 0.06%

注：过去三个季度为2015年10月1日-2015年12月31日。

3.3.8 报告期基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) A/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.20% 0.08% 0.01% 1.46% 0.07%

(2) C/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.13% 0.07% 0.01% 1.32% 0.06%

注：过去三个季度为2015年10月1日-2015年12月31日。

3.3.9 报告期基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) A/B级

阶段 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率为(%)

过去三个月 2.20% 0.08% 0.