# 富国低碳新经济混合型证券投资基金

## 2016 第一季度报告

| | |
|---|---|
| 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04月22日 |

§1 重要提示

富国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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月20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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至2016年3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 富国低碳新经济混合 |
| 基金主代码 | 001985 |
| 交易代码 | 001985 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年12月18日 |
| 报告期末基金份额总额(单位:份) | 1,054,127,173.97 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于低碳新经济主题相关股票,通过精选个股和严格风险控制,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 | 本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%。 |
| 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。 |
| 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(2016年01月01日-2016年03月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -77,455,631.36 |
| 2.本期利润 | -12,354,056.07 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0115 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,047,754,419.89 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.994 |

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。

3.2基金净值表现

3.2.1本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

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -1.00% | 1.84% | -8.98% | 1.58% | 7.98% | 0.26% |

注:过去三个月指2016年1月1日-2016年3月31日。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计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

注:1.截止日期为2016年3月31日。

2.本基金于2015年12月18日成立,自合同生效日起至本报告期末不足一年。建仓期6个月,从2015年12月28日至2016年6月28日,本期末建仓期还未结束。

§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 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 杨栋 | 本基金经理兼任富国天合稳健优选混合型证券投资基金基金经理 | 2015-12-18 | - | 5年 | 硕士,自2011年5月至2015年8月在富国基金管理有限公司任助理行业研究员、行业研究员;自2015年8月起任富国天合稳健优选混合型证券投资基金基金经理;自2015年12月起任富国低碳新经济混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。 |

注:1、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;首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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新经济混合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》、《富国低碳新经济混合型证券投资基金基金合同》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,以为投资者减少和分散风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标,管理和运用基金资产,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求,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、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、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同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日反向交易列为限制行为,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的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合,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、通过公平性交易的事后分析评估系统,对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估,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、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为,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性解释,并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字,并经督察长、总经理审阅签字后,归档保存,以备后查。

本报告期内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。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同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17次同日反向交易成交较少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

今年一季度受国内外宏观变量剧烈波动的影响,股市也经历了大幅震荡。利润美联储的加息节奏、汇率预期、通胀预期以及国内政治经济政策的风向预期混乱。汇率是导致开年下跌的直接因素,随着美元指数走弱、国内经济企稳,对汇率担忧暂时消除。通胀预期也受蔬菜、肉类价格持续上升的影响一度混乱,从而引发市场对国内中长期货币政策的担忧,现在通胀问题也趋于明朗。

本基金开年以来仓位较低,板块和个股均衡配置。考虑到一季度股市流动性不佳,降低了持股集中度。分别在春节前和三月中旬美联储议息会议后提升仓位。板块配置方面,重点配置了消费升级、养殖、涨价弹性较大的细分品类、军工等。考虑到汇率、通胀、经济增长预期趋于稳定,市场风险偏好适度回升,本基金将适度提高持股集中度,降低仓位波动,自下而上寻找优质个股,中长线持有。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为-1.00%,同期业绩比较基准收益率为-8.98%。

4.6报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期无需要说明的相关情形。

§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 | 940,044,419.16 | 83.98 |
| | 其中:股票 | 940,044,419.16 | 83.98 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,835,313.06 | 0.16 |
| | 其中:债券 | 1,835,313.06 | 0.16 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 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 | 176,294,389.21 | 15.75 |
| 7 | 其他资产 | 1,249,464.01 | 0.11 |
| 8 | 合计 | 1,119,423,585.44 | 100.00 |

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 78,316,742.32 | 7.47 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 633,870,884.80 | 60.50 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 19,786,580.84 | 1.89 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 11,184,560.00 | 1.07 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 47,302,045.98 | 4.51 |
| J | 金融业 | 41,366,103.00 | 3.95 |
| K | 房地产业 | 29,376,184.38 | 2.80 |
| L | 租赁和商务服务业 | 20,049,100.00 | 1.91 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 9,901,665.00 | 0.95 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 48,890,552.84 | 4.67 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 940,044,419.16 | 89.72 |

5.3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) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002511 | 中顺洁柔 | 4,866,399 | 60,343,347.60 | 5.76 |
| 2 | 002626 | 金达威 | 2,633,767 | 55,546,146.03 | 5.30 |
| 3 | 002458 | 益生股份 | 1,087,878 | 51,064,993.32 | 4.87 |
| 4 | 600602 | 仪电电子 | 4,428,442 | 49,731,403.66 | 4.75 |
| 5 | 600151 | 航天机电 | 2,890,864 | 32,319,859.52 | 3.08 |
| 6 | 600804 | 鹏博士 | 1,517,421 | 32,214,847.83 | 3.07 |
| 7 | 603566 | 普莱柯 | 654,828 | 31,379,357.76 | 2.99 |
| 8 | 002335 | 科华恒盛 | 687,500 | 29,177,500.00 | 2.78 |
| 9 | 000673 | 当代东方 | 1,030,186 | 28,021,059.20 | 2.67 |
| 10 | 002074 | 国轩高科 | 752,980 | 27,656,955.40 | 2.64 |

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | 1,835,313.06 | 0.18 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,835,313.06 | 0.18 |

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 128011 | 汽模转债 | 12,747 | 1,835,313.06 | 0.18 |

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投资。

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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| | |
|---|---|
| 公允价值变动总额合计(元) | - |
| 股指期货投资本期收益(元) | - |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | - |

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| | |
|---|---|
| 公允价值变动总额合计(元) | - |
| 国债期货投资本期收益(元) | - |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) | - |

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2申明本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 770,074.23 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 40,486.76 |
| 5 | 应收申购款 | 438,903.02 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,249,464.01 |

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,077,330,023.06 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 21,264,693.56 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 44,467,542.65 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,054,127,173.97 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | - |

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国低碳新经济混合型证券投资基金的文件

2、富国低碳新经济混合型证券投资基金基金合同

3、富国低碳新经济混合型证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国低碳新经济混合型证券投资基金财务报表及报表附注

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2存放地点

上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

8.3查阅方式

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话:95105686、4008880688(全国统一,免长途话费)

公司网址:http://www.fullgoal.com.cn

富国基金管理有限公司

2016年04月22日

# 富国富钱包货币市场基金

## 2016 第一季度报告

| | |
|---|---|
| 基金管理人: | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人: | 中信银行股份有限公司 |
| 报告送出日期: | 2016年04月22日 |

§1 重要提示

富国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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月20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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至2016年3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 富国富钱包货币 |
| 基金主代码 | 000638 |
| 交易代码 | 000638 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年05月07日 |
| 报告期末基金份额总额(单位:份) | 1,620,337,020.27 |
| 投资目标 | 在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在120天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。<br>在投资管理过程中,基金管理人将基于"定性与定量相结合、保守与积极相结合"的原则,根据短期利率的变动和市场格局的变化,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为当期银行个人活期存款利率(税后)。 |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。 |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 |

§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(2016年01月01日-2016年03月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 13,088,705.42 |
| 2.本期利润 | 13,088,705.42 |
| 3.期末基金资产净值 | 1,620,337,020.27 |

注:所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2基金净值表现

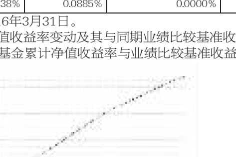
3.2.1本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 0.7530% | 0.0038% | 0.0885% | 0.0000% | 0.6645% | 0.0038% |

注:过去三个月指2016年1月1日-2016年3月31日。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

自基金合同生效以来富国富钱包货币基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:1.截止日期为2016年3月31日。

2.本基金于2014年05月07日成立;建仓期6个月,即从2014年05月07日至2014年11月06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 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 万莉 | 本基金经理兼任富国天时货币市场基金、富国收益宝货币市场基金、富国收益宝交易型货币市场基金基金经理 | 2015-10-09 | - | 10年 | 硕士,自2006年7月至2008年6月在广州银行任债券交易员;自2008年6月至2013年7月在长信基金管理有限责任公司工作,历任债券交易员、基金经理助理、基金经理;自2013年7月至2014年6月中融基金(原道富基金)管理有限公司工作,任现金管理投资总监;自2014年6月加入富国基金管理有限公司,2014年6月至2015年10月任固定收益投资部现金管理主管,2015年10月起任富国天时货币市场基金、富国富钱包货币市场基金、富国收益宝货币市场基金基金经理,2015年12月起任富国收益宝交易型货币市场基金基金经理。现任固定收益投资部现金投资总监兼基金经理。具有基金从业资格。 |
| 王颀亮 | 本基金经理兼任富国收益宝货币市场基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富国收益宝交易型货币市场基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理 | 2015-04-27 | - | 6年 | 硕士,曾任上海国利货币经纪有限公司经纪人,自2010年9月至2013年7月在富国基金管理有限公司任交易员;2013年7月至2014年8月在富国基金管理有限公司任高级交易员兼研究助理;2014年8月至2015年2月任富国7天理财宝债券型证券投资基金基金经理,2014年8月起任富国收益宝货币市场基金基金经理,2015年4月起任富国恒利分级债券型证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金基金、富国天时货币市场基金基金经理,2015年11月起任富国收益宝交易型货币市场基金基金经理,2015年12月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金基金经理,2016年2月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。 |

注:1、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;首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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富钱包货币市场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》、《富国富钱包货币市场基金基金合同》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,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求,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、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、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同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日反向交易列为限制行为,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的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合,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、通过公平性交易的事后分析评估系统,对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估,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、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为,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性解释,并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字,并经督察长、总经理审阅签字后,归档保存,以备后查。

本报告期内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。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同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未出现成交较少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

2016年1季度,受新增信贷规模超预期增长、外汇占款大量流出、银行间融资规模快速上升、传统节假日以及季末等因素,导致银行间资金面脆弱。一月中下旬以及二月下旬,回购利率和短期债券利率快速上升。三月末,由于央行构建了金融机构宏观审慎评估体(MPA),季末资金更为紧张,回购利率出现大幅上涨。与此同时,央行3月1日期,普遍下调金融机构人民币存款准备金率0.5个百分点,以对冲上述资金紧张的情况。在此基础上一年期AAA短期融资券的收益率从1月初2.75%左右上升至一月底2.95%左右,在经过二月末后,逐渐下降至2.70%左右,又由于受资金面影响,三月底回升至2.8%附近。一年期国开债由一月初的2.45%左右回升到2.55%左右,在二月末后下降到2.3%后,于三月底又回升至2.5%。

报告期内,本基金秉承稳健投资原则,谨慎操作,根据流动性情况保持了一定比例的银行存单、短期融资券、短期存款、银行间逆回购等大类资产的配置,并根据组合持仓情况进行了一定的调整,组合总体流动性较好。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值收益率0.7530%,同期业绩比较基准收益率0.0885%。

4.6报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期无需要说明的相关情形。

§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 | 固定收益投资 | 1,143,541,742.47 | 61.04 |
| | 其中:债券 | 1,143,541,742.47 | 61.04 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 50,000,195.00 | 2.67 |
| | 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 | 650,617,663.59 | 34.73 |
| 4 | 其他资产 | 29,192,703.38 | 1.56 |
| 5 | 合计 | 1,873,352,304.44 | 100.00 |

5.2报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 16.29 | |
| | 其中:买断式回购融资 | - | |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 251,939,354.03 | 15.55 |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3基金投资组合平均剩余期限

5.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 112 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 117 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 96 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 32.75 | 15.55 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)—60天 | 12.94 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)—90天 | 12.34 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)—180天 | 33.18 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)—397天(含) | 22.60 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 113.81 | 15.55 |

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 209,978,142.23 | 12.96 |
| | 其中:政策性金融债 | 209,978,142.23 | 12.96 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 500,033,840.28 | 30.86 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 433,529,759.96 | 26.76 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,143,541,742.47 | 70.57 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | - | - |

5.5报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 150311 | 15进出11 | 1,000,000.00 | 99,968,242.38 | 6.17 |
| 2 | 111609073 | 16浦发CD073 | 1,000,000.00 | 98,883,467.97 | 6.10 |
| 3 | 011573009 | 15鲁高速SCP009 | 600,000.00 | 60,016,784.35 | 3.70 |
| 4 | 150419 | 15农发19 | 600,000.00 | 59,977,433.09 | 3.70 |
| 5 | 150416 | 15农发16 | 500,000.00 | 50,032,466.76 | 3.09 |
| 6 | 041569006 | 15鲁西化工CP001 | 500,000.00 | 50,015,975.54 | 3.09 |
| 7 | 011520003 | 15中铝SCP003 | 500,000.00 | 49,998,828.65 | 3.09 |
| 8 | 041572012 | 15宁夏国资CP001 | 500,000.00 | 49,993,713.31 | 3.09 |
| 9 | 011599712 | 15山钢SCP006 | 500,000.00 | 49,993,031.42 | 3.09 |
| 10 | 111516223 | 15上海银行CD223 | 500,000.00 | 49,760,950.93 | 3.07 |

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.2299% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.1641% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.2005% |

注:以上数据按工作日统计

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8投资组合报告附注

5.8.1基金计价方法说明。

本基金采用固定份额净值,基金份额账面净值始终保持为人民币1.00元。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益或损失。

5.8.2本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的声明

本报告期内本基金不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.4其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 18,748,233.13 |
| 4 | 应收申购款 | 10,444,470.25 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 29,192,703.38 |

5.8.5投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,827,935,252.56 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,966,735,836.76 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 2,174,334,069.05 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,620,337,020.27 |

注:红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源,统一计入本期总申购份额,基金转换转出作为本期赎回资金的来源,统一计入本期总赎回份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金,并且未持有本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国富钱包货币市场基金的文件

2、富国富钱包货币市场基金基金合同

3、富国富钱包货币市场基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国富钱包货币市场基金财务报表及报表附注

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2存放地点

上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

8.3查阅方式

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话:95105686、4008880688(全国统一,免长途话费)

公司网址:http://www.fullgoal.com.cn

富国基金管理有限公司

2016年04月22日

# 富国低碳环保混合型证券投资基金

## 2016 第一季度报告

| | |
|---|---|
| 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 |
| 报告送出日期: | 2016年04月22日 |

§1 重要提示

富国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。

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4月20日复核了本报告中财务指标、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至2016年3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 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<br>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 |
| 报告期末基金份额总额(单位:份) | 3,403,471,357.09 |
| 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。 |
| 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 |

§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(2016年01月01日-2016年03月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -2,400,665,697.14 |
| 2.本期利润 | -3,418,818,275.64 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.9803 |
| 4.期末基金资产净值 | 6,797,155,987.06 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.997 |

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。

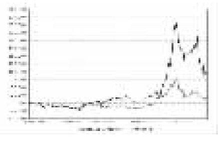
3.2基金净值表现

3.2.1本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

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -34.78% | 3.45% | -10.70% | 1.94% | -24.08% | 1.51% |

注:过去三个月指2016年1月1日-2016年3月31日。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计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



注:截止日期为2016年3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 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 魏伟 | 本基金基金经理兼任富国新兴产业股票型证券投资基金基金经理 | 2014-07-29 | - | 10年 | 硕士,曾任华富基金管理有限公司行业研究员;农银汇理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混合型证券投资基金基金经理,2015年3月起兼任富国新兴产业股票型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格 |

注:1、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;首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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混合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》、《富国低碳环保混合型证券投资基金基金合同》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,力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,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求,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、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、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同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日反向交易列为限制行为,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的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合,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、通过公平性交易的事后分析评估系统,对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估,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、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为,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性解释,并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字,并经督察长、总经理审阅签字后,归档保存,以备后查。

本报告期内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。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同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2次同日反向交易成交较少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

2016年1季度宏观经济复苏,社会流动性比较宽松,基建和房地产成为经济企稳的主要动力,工业品价格出现稳步上升,有一定的通胀苗头,但仍在可控范围内。2016年本基金的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,配置基本面较优质的个股。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为-34.78%,同期业绩比较基准收益率为-10.7%。

4.6报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期无需要说明的相关情形。

§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 | 4,277,377,556.79 | 61.97 |
| | 其中:股票 | 4,277,377,556.79 | 61.97 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 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 | 2,611,413,651.98 | 37.83 |
| 7 | 其他资产 | 13,982,497.71 | 0.20 |
| 8 | 合计 | 6,902,773,706.48 | 100.00 |

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,220,386,877.23 | 32.67 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 412,773,524.38 | 6.07 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 84,652,778.60 | 1.25 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,126,153,086.73 | 16.57 |
| J | 金融业 | 433,379,265.85 | 6.38 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 15,787.00 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 7,868.00 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 8,369.00 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 4,277,377,556.79 | 62.93 |

5.3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) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300017 | 网宿科技 | 10,086,725 | 589,165,607.25 | 8.67 |
| 2 | 002475 | 立讯精密 | 14,869,908 | 434,944,809.00 | 6.40 |
| 3 | 601939 | 建设银行 | 89,132,597 | 432,293,095.45 | 6.36 |
| 4 | 600276 | 恒瑞医药 | 9,006,686 | 425,385,779.78 | 6.26 |
| 5 | 300136 | 信维通信 | 13,796,403 | 406,855,924.47 | 5.99 |
| 6 | 600900 | 长江电力 | 29,889,316 | 367,040,800.48 | 5.40 |
| 7 | 600521 | 华海药业 | 11,013,172 | 287,003,262.32 | 4.22 |
| 8 | 002508 | 老板电器 | 6,019,803 | 276,850,739.97 | 4.07 |
| 9 | 600804 | 鹏博士 | 8,066,956 | 171,261,475.88 | 2.52 |
| 10 | 300366 | 创意信息 | 2,759,574 | 164,332,631.70 | 2.42 |

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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。

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投资。

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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| | |
|---|---|
| 公允价值变动总额合计(元) | - |
| 股指期货投资本期收益(元) | - |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | - |

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定,不允许投资股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| | |
|---|---|
| 公允价值变动总额合计(元) | - |
| 国债期货投资本期收益(元) | - |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) | - |

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本报告编制日前一年内,本基金持有的"华海药业"的发行主体浙江华海药业股份有限公司(以下简称"公司")于2015年6月10日因项目未经环评批复先行建设被临海市环境保护局以临环罚字[2015]63号《行政处罚决定书》处以责令停止未批项目建设(生产)、罚款人民币6万元的处罚;公司于2015年7月23日因川南一分厂不正常使用大气污染物处理设施的行为被临海市环境保护局以临环罚字[2015]108号《行政处罚决定书》处以责令停止违法行为和罚款人民币5万元的处罚;公司于2015年7月24日因川南一分厂废水超标排放被临海市环境保护局以临环罚字[2015]119号《行政处罚决定书》处以责令停止违法行为、罚款人民币58.6万元的处罚。

基金管理人将密切跟踪相关进展,遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余九名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 5,545,537.30 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 627,735.15 |
| 5 | 应收申购款 | 7,809,225.26 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 13,982,497.71 |

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300366 | 创意信息 | 164,332,631.70 | 2.42 | 筹划重大事项 |

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,927,765,507.37 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,492,206,233.06 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 1,016,500,383.34 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 3,403,471,357.09 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | - |

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录

1、中国证监会批准设立富国低碳环保混合型证券投资基金的文件

2、富国低碳环保混合型证券投资基金基金合同

3、富国低碳环保混合型证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5、富国低碳环保混合型证券投资基金财务报表及报表附注

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2存放地点

上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

8.3查阅方式

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话:95105686、4008880688(全国统一,免长途话费)

公司网址:http://www.fullgoal.com.cn

富国基金管理有限公司

2016年04月22日