

富国沪深 300 增强证券投资基金 2015 年第 4 季度报告

公告日期：2016-01-20

目录全部展开 目录全部收拢

重要提示

基金产品概况

基金基本情况

主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标

基金净值表现

☐ 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

☐ 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

其他指标

管理人报告

基金经理（或基金经理小组）简介

报告期内本基金运作遵规守信情况说明

公平交易专项说明

☐ 公平交易专项说明

☐ 公平交易制度和控制方法

☐ 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

☐ 异常交易行为的专项说明

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

☐ 报告期内基金的业绩表现

☐ 报告期内基金投资策略和运作分析

☐ 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

指数投资按行业分类的股票投资组合

积极投资按行业分类的股票投资组合

期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

☐ 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

☐ 本基金投资股指期货的投资政策

- 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- ☐ 本期国债期货投资政策
- ☐ 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
- ☐ 本期国债期货投资评价
- 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
- 投资组合报告附注
- ☐ 受到调查以及处罚情况
- ☐ 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
- ☐ 其他资产构成
- ☐ 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
- ☐ 期末指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
- ☐ 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
- ☐ 投资组合报告附注的其他文字描述部分
- 开放式基金份额变动
- 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
- 基金管理人持有本基金份额变动情况
- 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
- 影响投资者决策的其他重要信息
- 备查文件目录

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，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 2015 年 10 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

基金基本情况

项目	数值
基金简称	富国沪深 300 指数增强
场内简称	-
基金主代码	100038
前端交易代码	100038
后端交易代码	000154
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009-12-16

报告期末基金份额总额 1,022,433,303.43

投资目标 本基金为增强型股票指数基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

投资策略 本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。

业绩比较基准 $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 1.5\%$ （指年收益率，评价时按期间折算）

风险收益特征 本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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

基金保证人 -

主要财务指标

单位：人民币元

项目 2015-10-01 至 2015-12-31(元)

本期已实现收益 35,810,355.72

本期利润 283,773,543.61

加权平均基金份额本期利润 0.2612

期末基金资产净值 1,550,486,480.59

期末基金份额净值 1.516

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。

基金净值表现

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	20.51%	1.61%	16.08%	1.59%	4.43%	0.02%

注：过去三个月指 2015 年 10 月 1 日—2015 年 12 月 31 日

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 2015 年 12 月 31 日。

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。

其他指标

单位：元

序号 其他指标 报告期（2015-10-01 至 2015-12-31）

序号 其他指标 报告期（2015-12-31）

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		

方旻 本基金基金经理兼任量化投资总监助理、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LF)、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 2014-11-19 - 6 年 硕士，自 2010 年 2 月至 2014 年 4 月任富国基金管理有限公司定量研究员；2014 年 4 月至 2014 年 11 月任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LF)基金经理助理，2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LF)基金经理，2015 年 5 月起任富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金及富国中证银行指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 10 月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；兼任量化投资总监助理。具有基金从业资格。

李笑薇 本基金基金经理兼任副总经理、量化与海外投资部总经理、富国中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理 2009-12-23 - 13 年 博士，曾任摩根士丹利资本国际 Barra 公司(MSCIBARRA)，BARRA 股票风险评估部高级研究员；巴克莱国际投资管理公司(BarclaysGlobal Investrs)，大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员；2009 年 6 月加入富国基金管理有限公司，2011 年 1 月至 2012 年 5 月任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2009 年 12 月至今任富国沪深 300 增强证券投资基金基金经理，2011 年 10 月至今任富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LF)基金经理；兼任副总经理、量化与海外投资部总经理；具有中国基金从业资格。

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。

报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国沪深 300 增强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》、《富国沪深 300 增强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、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。

公平交易专项说明

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。

公平交易制度和控制方法

-

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-

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3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。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金净值增长率 20.51%，同期业绩比较基准收益率为 16.08%。

报告期内基金投资策略和运作分析

4 季度以来，随着两融余额的快速下降和场外配资的清理进入尾声，市场经过充分调整之后迎来一些积极变化，保险公司的频频举牌带动市场逐步震荡反弹。从结构来看，代表未来经济转型创新方向的创业板反弹力度较大，4 季度创业板指数上涨 30.32%，而受经济下行压力的影响，银行、资源品等行业占比较高的上证综指反弹幅度相对较小，4 季度上证综指上涨 15.93%。总体来看，经过 3 季度的大幅波动后，市场的资金供需、投资者信心、估值体系、结构主线都在寻找新的平衡。目前来看，4 季度的市场表现更多是一种超跌反弹，市场尚未出现较为清晰持续的投资主线，需继续观察市场的重建。4 季度末，随着美联储加息，人民币持续贬值，以及 1 月 8 日大非解禁的临近，投资者对资金面表现出较大担忧，市场再次出现调整。总体来看，沪深 300 指数 4 季度上涨 16.49%。

在投资管理上，我们坚持采取量化策略进行指数增强和风险管理。报告期内，本基金净值增长率为 20.51%，相对业绩基准的超额收益率为 4.43%，为投资者带来较高的超额收益。本基金在报告期内遇到多次大额申购赎回，同时受上市公司大面积停牌的影响，明显增加了本基金的交易成本。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

-

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。

报告期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益类投资	1,428,020,076.91	91.68
	其中：股票	1,428,020,076.91	91.68
2	固定收益投资	48,600.00	0.00
	其中：债券	48,600.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	128,276,493.02	8.24
7	其他资产	1,318,891.75	0.08
8	合计	1,557,664,061.68	100.00

指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采矿业	23,539,544.78	1.52
C	制造业	329,406,467.74	21.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,463,831.94	3.13
E	建筑业	50,357,273.37	3.25
F	批发和零售业	8,320,735.10	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	39,906,398.79	2.57
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,713,244.09	3.53
J	金融业	493,630,698.45	31.84
K	房地产业	75,464,911.32	4.87
L	租赁和商务服务业	2,293,702.71	0.15
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,802,342.00	0.18
	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	24,835,907.09	1.60
S	综合	553,832.52	0.04
	合计	1,154,288,889.90	74.45

积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	22,124,093.00	1.43
B	采矿业	20,047,763.62	1.29
C	制造业	180,893,148.58	11.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,348,366.40	0.15
E	建筑业	2,730,806.00	0.18
F	批发和零售业	15,967,464.88	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	2,653,135.02	0.17
H	住宿和餐饮业	1,068,194.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,024,432.67	0.71
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	3,560,998.84	0.23
M	科学研究和技术服务业	586,092.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	8,047,292.00	0.52
	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00

R	文化、体育和娱乐业	2,679,400.00	0.17
S	综合	0.00	0.00
	合计	273,731,187.01	17.65

期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：元

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	601318	中国平安	1,816,671	65,400,156	4.2180
2	601166	兴业银行	3,074,513	52,481,936.91	3.3849
3	600016	民生银行	5,253,231	50,641,146.84	3.2661
4	600030	中信证券	2,309,679	44,692,288.65	2.8825
5	600036	招商银行	2,422,823	43,586,585.77	2.8112
6	601169	北京银行	3,017,887	31,778,350.11	2.0496
7	601766	中国中车	2,470,950	31,751,707.5	2.0479
8	000001	平安银行	2,608,012	31,270,063.88	2.0168
9	600048	保利地产	2,877,940	30,621,281.6	1.9749
10	000776	广发证券	1,558,419	30,311,249.55	1.955

期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：元

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	000758	中色股份	1,230,134	18,304,393.92	1.180558
2	600682	南京新百	484,156	15,967,464.88	1.029836
3	600894	广日股份	797,400	15,940,026	1.028066
4	600572	康恩贝	1,030,300	13,764,808	0.887773
5	600835	上海机电	409,513	12,412,339.03	0.800545

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：元

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	0.00	0.00
2	央行票据	0.00	0.00
3	金融债券	0.00	0.00
	其中：政策性金融债	0.00	0.00
4	企业债券	0.00	0.00
5	企业短期融资券	0.00	0.00

6	中期票据	0.00	0.00	
7	可转债（可交换债）	48,600.00	0.0031	
8	同业存单	-	-	
9	其他	0.00	0.00	
10	合计	48,600.00	0.0031	

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：元

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	123001	蓝标转债	486	48,600	0

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

金额单位：元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	-------	-------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

金额单位：元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
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) -					

本基金本报告期末未投资股指期货。

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。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。
报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
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) -					

本基金本报告期末未投资国债期货。
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。
报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

单位：

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	123001	蓝标转债	486,600	0	

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

单位：元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值（元）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	------	--------------

注：本基金本报告期末未持有权证。
报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
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） -					

本基金本报告期末未投资股指期货。
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。
报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。
报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
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) -					

本基金本报告期末未投资国债期货。
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。
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

单位：元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。
投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

本报告编制日前一年内，中国证监会通报 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况，广发证券存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题，且涉及客户数量较多，被中国证监会采取责令限期改正的行政监管措施。本基金持有的“广发证券”的发行主体广发证券股份有限公司（以下简称“公司”）发布公告，公司于 2015 年 9 月 10 日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2015]71 号），公司涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案，中国证监会拟决定对公司责令整改、给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款。

本报告编制日前一年内，中国证监会通报 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况，中信证券存在违规为到期融资融券合约展期问题，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多，被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。本报告期内，本基金持有的“中信证券”的发行主体中信证券股份有限公司（以下简称“公司”）于 2015 年 11 月 26 日收到中国证监会调查通知书（稽查总队调查通字 153121 号），因公司在融资融券业务开展过程中，存在违反《证券公司监督管理条例》第八十四条“未按照规定与客户签订业务合同”规定之嫌，中国证监会决定对公司进行立案调查。

广发证券、中信证券为本基金跟踪标的指数的成份股。

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。

本基金持有的其余八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。

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

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。
其他资产构成

单位：元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	676,070.97
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	21,674.80
5	应收申购款	621,145.98
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	1,318,891.75

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位：元

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

单位：

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	600682	南京新百	15,967,464.88	1.0298	筹划重大事项
2	600572	康恩贝	13,764,808	0.8878	筹划重大事项

期末指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

单位：元

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
----	------	------	----------------	--------------	----------

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。
开放式基金份额变动（仅适用于开放式基金）

单位：份

项目 数值

报告期期初基金份额总额 1,114,369,162.19
报告期期间基金总申购份额 117,140,782.76
报告期期间总赎回份额 209,076,641.52
报告期期间基金拆分变动份额 0.00
报告期期末基金份额总额 1,022,433,303.43

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

项目 份额总额(份)

报告期期初管理人持有的本基金份额 41,788,692.37
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 41,788,692.37
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) 4.09

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

单位：份

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
合计		-			

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。
影响投资者决策的其他重要信息

-

备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国沪深 300 增强证券投资基金的文件
- 2、富国沪深 300 增强证券投资基金基金合同
- 3、富国沪深 300 增强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、富国沪深 300 增强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

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
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.fullgal.cm.cn>