富国强收益定期开放债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

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:2014年07月18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2014年7月16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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国强收益定期开放债券	
基金主代码	100070	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月18日	
报告期末基金份额总额	187,110,287.84	
投资目标	本基金投资目标是在追求本金长期安全的基础上,力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。	
投资策略	本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪,采用久期控制下的主动性投资策略,主要包括:久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段,对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测,相机启动、积极调整。	
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+0.5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	富国强收益定期开放债券A/B	富国强收益定期开放债券C
下属两级基金的交易代码	100070	100071
报告期末下属两级基金的份额总额(单位:份)	121,513,729.23	65,596,558.61

§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	A/B级 报告期(2014年04月01日-2014年06月30日)	C级 报告期(2014年04月01日-2014年06月30日)
1.本期已实现收益	1,833,189.37	854,538.08
2.本期利润	4,918,540.88	2,562,429.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.0395	0.0371
4.期末基金资产净值	129,053,296.74	69,117,165.75
5.期末基金份额净值	1.062	1.054

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

(1)A/B级

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	3.81%	0.09%	0.88%	0.01%	2.93%	0.08%

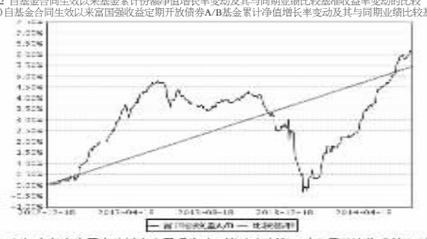
(2)C级

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	3.64%	0.09%	0.88%	0.01%	2.76%	0.08%

注:过去三个月指2014年4月1日—2014年6月30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

(1)自基金合同生效以来富国强收益定期开放债券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



(2)自基金合同生效以来富国强收益定期开放债券C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:截止日期为2014年6月30日。

本基金于2012年12月18日成立,建仓期6个月,即从2012年12月18日起至2013年6月17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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
冯彬	本基金基金经理兼任富国天理财宝债券型证券投资基金基金经理、富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、富国信用增强债券型证券投资基金基金经理、富国国有企业债债券型证券投资基金基金经理、富国富转债债券型证券投资基金基金经理、富国富转债债券型证券投资基金基金经理、富国富利宝货币市场基金基金经理	2012-12-18	-	7年	硕士,曾任平安证券有限责任公司债券交易员;光大证券股份有限公司债券投资经理;2012年7月至2012年11月任富国基金管理有限公司基金经理助理,2012年11月起任富国天理财宝债券型证券投资基金基金经理,2012年12月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年9月起任富国国有企业债债券型证券投资基金基金经理,2014年5月起任富国富转债债券型证券投资基金基金经理和富国富利宝货币市场基金基金经理。具有基金从业资格。
邹卉	本基金基金经理兼任富国天时货币市场基金基金经理、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理、富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、富国信用债债券型证券投资基金基金经理、富国恒利分级债券型证券投资基金基金经理	2013-12-23	-	9年	硕士,曾任上海国泰人寿保险有限公司投资部投资助理,东方基金管理有限公司债券研究员,自2008年9月至2011年7月任富国基金管理有限公司债券研究员,自2011年8月起任富国天时货币市场基金基金经理,2012年5月起任富国新天锋定期开放债券型证券投资基金基金经理,2012年11月起任富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理,2013年6月起任富国信用债债券型证券投资基金基金经理,2013年12月起任富国强收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,2014年3月起任富国恒利分级债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

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上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接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》、《富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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,管理和运用基金资产,无损害基金持有人利益的行为,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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年二季度国内经济仍在低位徘徊,房地产投资等出现下行拉低整体经济增速,CPI也维持在较低水平。央行货币政策方面,仍以稳定和偏宽松货币环境为基调,采用了多次定向降准和SLF等创新调控工具,以增强货币政策的针对性和有效性。在市场预期稳定的情况下,二季度货币市场利率总体平稳,也平抑了近几次季度末的资金紧张局面。

本季度,基金管理人严格按照基金合同进行投资管理,在中高等级债券持续上涨,低等级债券分化加大的债券市场环境中,并结合基金封闭期特点,采用了积极操作和控制信用风险的策略,一方面,持续买入中高等资质的个券,增加杠杆仓位,较好的获取了票息收入和资本利得。另一方面,对低等级债券,更重视信用面研究,精选基本面改善和有投资价值的个券,灵活交易获取差价。同时,对信用面恶化的个券,也及时进行了卖出操作,以控制组合信用风险。

展望下半年的债券市场,风险和不确定因素逐步累积,可能出现调整风险,操作上将更重视控制久期和信用风险,适当降低仓位以锁定收益。

4.4.2 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A/B级3.81%、C级3.64%;同期业绩比较基准收益率A/B级0.88%、C级0.88%。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	291,933,698.31	90.45
	其中:债券	291,933,698.31	90.45
	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	23,536,964.51	7.29
7	其他资产	7,302,255.60	2.26
8	合计	322,772,918.42	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票资产。

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

注:本基金本报告期末未持有股票资产。

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	251,523,698.31	126.92
5	企业短期融资券	40,410,000.00	20.39
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	291,933,698.31	147.31

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	122618	12统众债	300,000	30,450,000.00	15.37
2	124007	12西电梯	300,000	30,120,000.00	15.20
3	122033	09富力债	210,540	21,171,902.40	10.68
4	041455003	14金隅CP001	200,000	20,264,000.00	10.23
5	041461005	14西基投CP001	200,000	20,146,000.00	10.17

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

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

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。

本基金本报告期末未持有股票资产。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	36,981.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,265,274.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,302,255.60

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不存在流通受限情况。

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

项目	A/B级	C级
报告期期初基金份额总额	136,481,200.75	83,648,567.31
报告期期间基金总申购份额	2,895.32	-
减:报告期期间基金总赎回份额	14,970,366.84	18,052,008.70
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	121,513,729.23	65,596,558.61

§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	-
报告期末管理人持有的本基金份额	-
报告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强收益定期开放债券型证券投资基金的文件
2、富国强收益定期开放债券型证券投资基金合同
3、富国强收益定期开放债券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、富国强收益定期开放债券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
2014年07月18日

上证综指交易型开放式指数证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30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:2014年07月18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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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2014年4月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上证综指ETF
基金主代码	510210
交易代码	510210
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2011年01月30日
报告期末基金份额总额(单位:份)	118,138,513.00
投资目标	紧密跟踪标的指数(上证综合指数),追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用最优化抽样复制标的指数,最优化抽样依托富国量化投资平台,利用长期稳定的风险模型,使用"跟踪误差最小化"的最优化方式创建目标组合,从而实现对标的指数的紧密跟踪。
业绩比较基准	上证综合指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金,跟踪上证综合指数,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

§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(2014年04月01日-2014年06月30日)
1.本期已实现收益	701,764.25
2.本期利润	3,289,687.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0274
4.期末基金资产净值	261,423,934.34
5.期末基金份额净值	2.213

注:1.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。
2.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	1.24%	0.77%	0.74%	0.77%	0.50%	0.00%

注:过去三个月指2014年4月1日—2014年6月30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2014年6月30日。

本基金合同于2011年1月30日生效,本基金建仓期3个月,即从2011年1月30日起至2011年4月29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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王保合	本基金基金经理兼任量化投资副总监、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、富国沪深300增强证券投资基金基金经理、富国创业板指数分级证券投资基金基金经理、富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理	2011-03-03	-	9年	博士,曾任富国基金管理有限公司研究员;富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理;2011年3月起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,2013年9月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理,2014年4月起任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理;兼任量化投资副总监;具有基金从业资格。

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上证综指交易型开放式指数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》、《上证综指交易型开放式指数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,管理和运用基金资产,无损害基金持有人利益的行为,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1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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2014年二季度,伴随着"定向降准"等多达17项微刺激政策出台,国内经济开始企稳回暖。6月官方制造业PMI指数升至51,连续4月上升,出口、消费、工业等数据也有明显回升,政府微刺激政策的效果已经开始显现,稳增长的效应也更加明显。二季度资本市场开始表现先扬后抑,之后经历了震荡盘整,并在6月下旬开始稳步回升。市场情绪仍然以谨慎为主,但已逐渐显现出看多趋势,上证综指二季度整体微涨0.74%。

在投资管理上,我们坚持采取量化策略进行指数跟踪,报告期内,本基金的年化跟踪误差为1.55%。

展望2014年三季度,随着微刺激政策的进一步落实,经济将继续企稳回暖。二级市场投资者的情绪将在边际获得较大改善。预计三季度市场整体走势将明显好于上半年,改革的逐渐兑现将使得投资者对于经济的信心有系统性的回升,同时仍然需要注意市场的系统性信用风险的变化。

4.4.2 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1.24%,同期业绩比较基准收益率为0.74%。

§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	257,777,881.80	98.47
	其中:股票	257,777,881.80	98.47
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	4,012,655.88	1.53
7	其他资产	1,190.34	0.00
8	合计	261,791,728.02	100.00

5.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.3 报告期末指数投资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	2,143,718.00	0.82
B	采矿业	44,695,063.79	17.10
C	制造业	72,101,375.27	27.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,882,276.58	4.55
E	建筑业	8,006,204.44	3.06
F	批发和零售业	6,706,961.00	2.57
G	交通运输、仓储和邮政业	10,504,925.00	4.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,035,881.42	1.93
J	金融业	81,201,762.74	31.06
K	房地产业	7,594,651.81	2.91
L	租赁和商务服务业	1,361,932.00	0.52
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,032,209.75	0.78
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	3,554,229.00	1.36
S	综合	956,691.00	0.37
	合计	257,777,881.80	98.61

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.4.1 报告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	601857	中国石油	2,887,100	21,768,734.00	8.33
2	601288	农业银行	5,716,500	14,405,580.00	5.51
3	601988	中国银行	4,058,800	10,349,940.00	3.96
4	600028	中国石化	1,645,988	8,674,356.76	3.32
5	601628	中国人寿	367,800	5,005,758.00	1.91
6	601166	兴业银行	411,170	4,124,035.10	1.58
7	600000	浦发银行	446,040	4,036,662.00	1.54
8	600036	招商银行	393,391	4,028,323.84	1.54
9	601088	中国神华	267,400	3,887,996.00	1.49
10	601328	交通银行	989,720	3,840,113.60	1.47

5.4.2 报告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前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.5 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。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券资产。

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 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。

5.9 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。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10.2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。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1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。

5.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末投资国债期货。

5.11.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1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。

本基金持有的中国石化于2013年11月25日公告其位于青岛经济技术开发区的原油管道发生破裂,在开始抢险处置后,市政排水暗渠发生爆燃,导致周边行人、抢险人员的重大伤亡,中国政府已派出事故调查组进行全面调查。2014年1月13日,中国石油化工股份有限公司公告了国务院事故调查组对上述事故的调查处理结果。

中国石化为本基金跟踪标的指数的样本股,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9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。

5.12.2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。

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。

5.12.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	95.90
2	应收证券清算款	446.94
3	应收股利	-
4	应收利息	647.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,190.34

5.12.4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。

5.12.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.12.5.1 期末指数投资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不存在流通受限情况。

5.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.12.6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	118,638,513.00
报告期期间基金总申购份额	4,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	4,500,000.00
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	118,138,513.00

§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	-
报告期末管理人持有的本基金份额	-
报告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上证综指交易型开放式指数证券投资基金的文件
2、上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同
3、上证综指交易型开放式指数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、上证综指交易型开放式指数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
2014年07月18日

富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30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:2014年07月18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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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2014年4月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	富国上证综指ETF联接
基金主代码	100053
交易代码	前端交易代码:100053 后端交易代码:000164
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年01月30日
报告期末基金份额总额(单位:份)	321,769,911.68
投资目标	通过主要投资于目标ETF,即富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为目标ETF(富国上证综指交易型开放式指数证券投资