富国产业债债券型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015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:2015年07月21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2015年7月17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4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国产业债券
基金主代码	100058
交易代码	前端交易代码:100058 后端交易代码:100059
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月05日
报告期末基金份额总额(单位:份)	2,387,944,211.29
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上,力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例;在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上,根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。
业绩比较基准	中债综合指数
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(2015年04月01日-2015年06月30日)
1.本期已实现收益	83,508,935.34
2.本期利润	64,085,901.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0263
4.期末基金资产净值	2,535,684,693.19
5.期末基金份额净值	1.062

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。

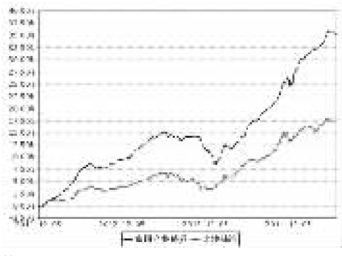
3.2基金净值表现

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	2.51%	0.09%	2.35%	0.10%	0.16%	-0.01%

注:过去三个月指2015年4月1日—2015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2015年6月30日。

本基金于2011年12月5日成立。本基金建仓期6个月,即从2011年12月5日起至2012年6月4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		
张钫	本基金基金经理兼任固定收益投资副总监、富国优化增强债券型证券投资基金、富国天盈债券型证券投资基金(LOF)、富国信用增强债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014-07-29		6年	硕士,曾任华富基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理、基金经理;自2014年3月至2014年7月在富国基金管理有限公司人力资源部工作,自2014年7月起在富国基金管理有限公司固定收益投资部工作,并自2014年7月起任富国天盈债券型证券投资基金(LOF)、富国产业债债券型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金基金经理,2014年10月起任富国国有企业债债券型证券投资基金和富国信用增强债券型证券投资基金基金经理,2014年11月起任富国新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;兼任固定收益投资副总监。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富国产业债债券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》、《富国产业债债券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、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,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

二季度,债市区间震荡,本基金仓位变化不大,收益主要来自票息收入。本基金将持续把投资重点放在信用债上,中周期内寻找信用投资的超额收益机会,适时调整仓位和久期,争取为基金持有人带来可持续的稳定投资回报。

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2.51%,同期业绩比较基准收益率为2.35%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	2,431,033,493.38	95.74
	其中:债券	2,325,626,150.92	91.59
	资产支持证券	105,407,342.46	4.15
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	9,800,124.90	0.39
	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	39,349,648.49	1.55
7	其他资产	58,993,127.24	2.32
8	合计	2,539,176,394.01	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	131,029,990.00	5.17
	其中:政策性金融债	130,999,000.00	5.17
4	企业债券	1,061,770,086.22	41.87
5	企业短期融资券	623,512,000.00	24.59
6	中期票据	446,306,000.00	17.60
7	可转债	33,208,074.70	1.31
8	中小企业私募债	29,800,000.00	1.180
9	其他	-	-
10	合计	2,325,626,150.92	91.72

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	112190	11亚迪02	898,440	94,785,420.00	3.74
2	122110	11众和债	836,000	82,178,800.00	3.24
3	041460096	14宜兴城投CP001	700,000	70,665,000.00	2.79
4	101556018	15远东租赁MTN001	700,000	69,573,000.00	2.74
5	101570003	15京政路桥MTN001	600,000	60,816,000.00	2.40

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

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(%)
1	119027	侨城05	410,000	38,586,616.44	1.52
2	119026	侨城04	370,000	34,822,068.49	1.37
3	119025	侨城03	340,000	31,998,657.53	1.26

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前十名股票超出基金合同规定的备选股票库

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	224,452.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	55,414,075.07
5	应收申购款	3,354,600.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,993,127.24

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113501	洛钼转债	9,760,800.00	0.38

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	2,524,904,388.59
报告期期间基金总申购份额	128,964,967.56
减:报告期期间基金总赎回份额	265,925,144.86
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	2,387,944,211.29

§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	25,000,500.02
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	25,000,500.02
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.05

注:买入/申购含红利再投资、转换入份额;卖出/赎回含转换出份额。

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产业债债券型证券投资基金的文件

2、富国产业债债券型证券投资基金基金合同

3、富国产业债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、富国产业债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
2015年07月21日

富国新兴产业股票型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015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:2015年07月21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2015年7月17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4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国新兴产业股票
基金主代码	001048
交易代码	前端交易代码:001048 后端交易代码:001049
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年03月12日
报告期末基金份额总额(单位:份)	4,271,519,139.69
投资目标	本基金主要投资于新兴产业相关股票,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	本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于较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(2015年04月01日-2015年06月30日)
1.本期已实现收益	1,914,443,298.11
2.本期利润	1,712,372,923.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.2960
4.期末基金资产净值	5,616,110,733.19
5.期末基金份额净值	1.315

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。

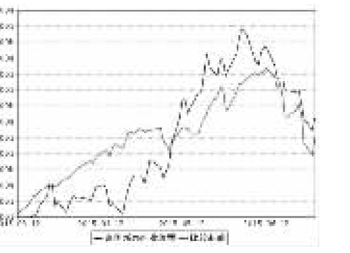
3.2基金净值表现

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	26.81%	2.71%	11.92%	2.11%	14.89%	0.60%

注:过去三个月指2015年4月1日—2015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2015年6月30日。

本基金于2015年3月12日成立,自合同生效日起至本报告期末不足一年。

本基金建仓期6个月,即从2015年3月12日起至2015年9月11日,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§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低碳环保股票型证券投资基金基金经理	2015-03-12		9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股票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

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新兴产业股票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》、《富国新兴产业股票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30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

2015年2季度宏观经济开始底部企稳,并逐步向上,央行进行了持续降准和降息,房地产市场显著回暖,市场流动性总体比较宽松,新兴产业板块经过1-5月的快速上涨,估值整体相对偏高,蓝筹股的价值开始相对突出,2015年本基金的策略是加强宏观经济和具体公司的研究,寻找确定性强的机会,配置基本面较具潜力的个股。

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26.81%,同期业绩比较基准收益率为11.92%。

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	3,744,121,225.43	59.22
	其中:股票	3,744,121,225.43	59.22
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	2,322,124,801.48	36.73
7	其他资产	256,603,026.15	4.06
8	合计	6,322,849,053.06	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	1,952,779,084.19	34.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,866.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,508,185,476.74	26.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	283,153,798.50	5.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,744,121,225.43	66.67

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	002568	百润股份	4,718,069	620,567,615.57	11.05
2	600398	海澜之家	28,628,857	519,041,177.41	9.24
3	600029	南方航空	33,649,230	489,259,804.20	8.71
4	002044	江苏三友	9,022,298	404,198,950.40	7.20
5	601021	春秋航空	3,203,926	403,983,029.34	7.19
6	600115	东方航空	31,388,800	386,710,016.00	6.89
7	601111	中国国航	14,858,895	228,232,627.20	4.06
8	002475	立讯精密	6,192,505	209,368,594.05	3.73
9	600410	华胜天成	4,523,800	155,437,768.00	2.77
10	002304	洋河股份	1,946,834	135,032,406.24	2.40

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

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

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,深圳证券交易所于2014年6月30日发布《关于对江苏三友集团股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》,江苏三友集团股份有限公司未能及时、准确履行相关信息披露义务,深圳证券交易所决定给予通报批评的处分。

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	2,741,039.04
2	应收证券清算款	239,407,409.29
3	应收股利	-
4	应收利息	477,932.18
5	应收申购款	13,976,645.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	256,603,026.15

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	002044	江苏三友	404,198,950.40	7.20	筹划重大事项
2	601021	春秋航空	403,983,029.34	7.19	筹划重大事项
3	601111	中国国航	228,232,627.20	4.06	筹划重大事项
4	600410	华胜天成	155,437,768.00	2.77	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	5,973,964,636.24
报告期期间基金总申购份额	3,879,358,130.25
减:报告期期间基金总赎回份额	5,581,803,626.80
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	4,271,519,139.69

§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新兴产业股票型证券投资基金的文件

2、富国新兴产业股票型证券投资基金基金合同

3、富国新兴产业股票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、富国新兴产业股票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
2015年07月21日

富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015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:2015年07月21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2015年7月17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4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国中证新能源汽车指数分级		
场内简称	新能源车		
基金主代码	161028		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年03月30日		
报告期末基金份额总额	6,426,304,236.55		
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证新能源汽车指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资,依托富国量化投资平台,利用长期稳定的风险模型和交易成本模型,按照成份股在中证新能源汽车指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪中证新能源汽车指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
业绩比较基准	95%×中证新能源汽车指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征。		
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		
下属分级基金的基金简称	新能车A	新能车B	富国中证新能源汽车指数分级
下属分级基金场内简称	新能车A	新能车B	新能源车
下属分级基金的交易代码	150211	150212	161028
报告期末下属分级基金的份额总额(单位:份)	1,286,008,143.00	1,286,008,144.00	3,854,287,949.55
下属分级基金的风险收益特征	富国新能源汽车A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征。	富国新能源汽车B份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。	本基金为股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征。

§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04月01日-2015年06月30日)
1.本期已实现收益	695,049,622.31
2.本期利润	940,976,624.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.1232
4.期末基金资产净值	7,022,952,313.53
5.期末基金份额净值	1.093

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	9.30%	2.88%	20.12%	2.93%	-10.82%	-0.05%

注:过去三个月指2015年4月1日—2015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:1、截止日期为2015年6月30日。

2、本基金于2015年3月30日成立,自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月,即从2015年3月30日起至2015年9月29日,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

3.3其他指标

其他指标	报告期末(2015年06月30日)
新能车A与新能车B基金份额配比	1:1
期末新能车A份额参考净值	1.015
期末新能车A份额累计参考净值	1.015
期末新能车B份额参考净值	1.171
期末新能车B份额累计参考净值	1.171
2015年富国新能车A的预计年收益率	6.00%

§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		
牛志冬	本基金基金经理兼任富国中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理	2015-05-13		8年	硕士,自2007年7月至2010年8月任华夏基金管理有限公司研究员;自2010年8月至2012年4月任富国基金管理有限公司基金经理助理;自2012年4月至2015年3月任富国基金管理有限公司投资经理;自2015年5月起任富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金的基金经理。具有基金从业资格。
张圣贤	本基金经理兼任富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理	2015-06-05		8年	硕士,自2007年7月至2015年3月任上海申银万国证券研究所有限公司分析师;自2015年3月至2015年6月任富国基金管理有限公司基金经理助理;2015年6月起任富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
章椹元	本基金前任基金经理	2015-03-30	2015-05-13	7年	硕士,自2008年7月至2011年5月在建信基金管理有限责任公司任研究员助理、初级研究员、研究员;自2011年5月至2013年12月在富国基金管理有限公司任基金经理助理,自2013年12月至2015年5月任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理,2014年4月至2015年5月任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理,2014年9月至2015年5月任富国中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理,2014年12月至2015年5月任富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金经理,2015年3月至2015年5月任富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、中证新能源汽车指数分级证券投资基金基金经理,2015年4月至2015年5月任富国中证银行指数分级证券投资基金。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中证新能源汽车指数分级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》、《富国中证新能源汽车指数分级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,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9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

自2014年四季度以来,央行连续降息带来的流动性宽松,叠加金融改革、经济转型降低风险溢价等因素促使居民的大量资产配置行为发生改变,股市替代房地产,成为居民资产配置的首选。4、5月份,在股市财富效应的驱动下,股市新增开户数大幅增加,资金加速流入A股市场,上证综指最高达到5178点,创业板指数持续创出新高,最高达到4037点。进入6月中旬以后,随着市场去杠杆,部分股票的快速下跌对投资者造成恐慌,从而引发"下跌—杠杆平仓—下跌"的负向循环,上证综指自高点快速回落超过15%,创业板指数自高点快速回落近30%。回顾2015年二季度,在场内券商融资及场外配资等杠杆资金的作用下,A股市场出现了大幅波动,特别是6月份以后主要指数日最高振幅超过10%。总体来看,中证新能源汽车指数二季度整体上涨21.1%。

在投资管理上,本基金采取完全复制的被动式指数基金管理策略,采用量化和人工管理相结合的方法,处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件。本基金在报告期内遇到多次大额申购赎回,在一定程度上增加了本基金的交易成本,我们仍然较好地将跟踪误差控制在合理水平之内。

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9.30%,同期业绩比较基准收益率为20.12%。

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	6,808,345,093.97	89.82
	其中:股票	6,808,345,093.97	89.82
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	748,857,164.20	9.88
7	其他资产	22,409,318.61	0.30
8	合计	7,579,611,576.78	100.00

5.2报告期末积极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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	309,060.00	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	309,060.00	0.00

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	-	-
B	采矿业	170,312,270.96	2.43
C	制造业	5,752,034,812.35	81.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	58,990,648.50	0.84
F	批发和零售业	65,329,384.92	0.93
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	514,547,442.68	7.33
J	金融业	-	-
K	房地产业	48,931,445.37	0.70
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	197,890,029.19	2.82
	合计	6,808,036,033.97	96.94

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	600406	国电南瑞	13,882,824	287,235,628.56	4.09
2	600066	宇通客车	12,665,618	260,278,449.90	3.71
3	002594	比亚迪	4,461,008	246,381,471.84	3.51
4	000559	万向钱潮	10,927,662	238,878,691.32	3.40
5	000839	中信国安	9,644,116	227,311,814.12	3.24
6	300124	汇川技术	4,498,322	215,919,456.00	3.07
7	000009	中国宝安	12,133,049	197,890,029.19	2.82
8	600525	长园集团	8,545,409	175,779,063.13	2.50
9	000970	中科三环	8,117,601	167,303,756.61	2.38
10	600482	风帆股份	3,934,228	166,732,582.64	2.37

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

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	601211	国泰君安	9,000	309,060.00	0.00

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。

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投资。

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投资股指期货。

5.10.2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。

5.11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:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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。

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。

5.12.2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。

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。

5.12.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,764,925.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	141,163.48
5	应收申购款	19,451,349.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	51,880.10
8	其他	-
9	合计	22,409,318.61

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

金额单位:人民币元

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
1	000839	中信国安	227,311,814.12	3.24	筹划重大事项
2	600482	风帆股份	166,732,582.64	2.37	筹划重大事项

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:本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限的股票。

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

项目	新能车A	新能车B	富国中证新能源汽车指数分级
报告期期初基金份额总额	-	-	6,018,944,449.58
报告期期间基金总申购份额	-	-	7,074,212,781.15
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	6,666,852,994.18
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	1,286,008,143.00	1,286,008,144.00	-2,572,016,287.00
报告期期末基金份额总额	1,286,008,143.00	1,286,008,144.00	3,854,287,949.55

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§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中证新能源汽车指数分级证券投资基金的文件

2、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金基金合同

3、富国中证新能源汽车指数分级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、富国中证新能源汽车指数分级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
2015年07月21日