富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)

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：	中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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。

本报告中财务资料未经审计。

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500指数增强（LOF）
场内简称	富国500
基金主代码	161017
交易代码	前端交易代码：161017 后端交易代码：161021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年10月12日
报告期末基金份额总额（单位：份）	137，514，390.28
投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证500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	本基金业绩比较基准=95%×中证500指数收益率+1%（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	中国农业银行股份有限公司

§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	81，598，170.61
2.本期利润	23，139，669.17
3.加权平均基金份额本期利润	0.1199
4.期末基金资产净值	324，335，886.39
5.期末基金份额净值	2.359

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。

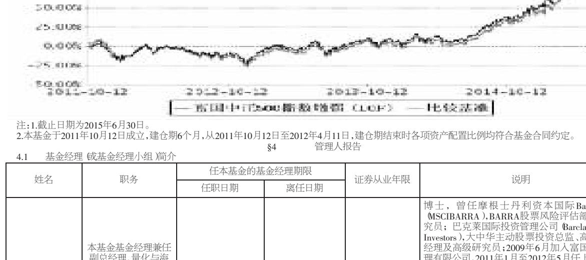
3.2 基金净值表现

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	15.69%	2.91%	21.99%	2.75%	-6.30%	0.16%

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2011年10月12日成立，建仓期6个月，从2011年10月12日至2012年4月11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		
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、富国沪深300增强证券投资基金基金经理	2011-10-12		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 Investors），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（LOF）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。
徐幼华	本基金基金经理兼任兼任量化投资总监、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国中证工业4.0指数分级证券投资基金、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理	2011-10-12		10年	硕士，曾任上海京华创业投资有限公司投资经理助理；2006年7月至2008年12月任富国基金管理有限公司金融工程部数量研究员，2009年1月至2011年5月任富国基金管理有限公司另类投资部数量研究员、基金经理助理，2011年5月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理，2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2015年6月起任富国中证工业4.0指数分级证券投资基金、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理；兼任量化投资总监。具有基金从业资格。
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、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（LOF）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（LOF）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；兼任量化投资总监助理。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中证500指数增强型证券投资基金（LOF）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500指数增强型证券投资基金（LOF）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，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

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500指数二季度整体上涨22.79%。

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16.5%，相对业绩基准的超额收益率为-6%。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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金净值增长率15.69%，同期业绩比较基准收益率为21.99%。

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	311，028，406.95	50.49
	其中：股票	311，028，406.95	50.49
2	固定收益投资	23，249.60	0.00
	其中：债券	23，249.60	0.00
	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	277，399，874.67	45.03
7	其他资产	27，528，611.50	4.47
8	合计	615，980，142.72	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	199，134.52	0.06
B	采矿业	-	-
C	制造业	29，491，656.63	9.09
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	1，838，225.00	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	2，427，450.70	0.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4，386，194.39	1.35
J	金融业	3，434.00	0.00
K	房地产业	3，902，676.00	1.20
L	租赁和商务服务业	481，102.02	0.15
M	科学研究和技术服务业	839，656.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	491，001.06	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	872，700.22	0.27
R	文化、体育和娱乐业	1，386，042.00	0.43
S	综合	-	-
	合计	46，319，272.54	14.28

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	4，492，630.16	1.39
B	采矿业	8，893，030.00	2.74
C	制造业	144，940，695.32	44.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7，216，786.50	2.23
E	建筑业	3，263，662.50	1.01
F	批发和零售业	17，682，755.21	5.45
G	交通运输、仓储和邮政业	3，785，588.00	1.17
H	住宿和餐饮业	2，280，176.80	0.70
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17，569，072.50	5.42
J	金融业	2，793，221.30	0.86
K	房地产业	19，858，998.10	6.12
L	租赁和商务服务业	9，897，251.20	3.05
M	科学研究和技术服务业	6，325，040.00	1.95
N	水利、环境和公共设施管理业	1，382，338.50	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1，102，132.20	0.34
R	文化、体育和娱乐业	8，739，639.82	2.69
S	综合	4，486，116.30	1.38
	合计	264，709，134.41	81.62

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	600645	中源协和	75，100	5，958，434.00	1.84
2	002183	怡亚通	73，800	5，398，470.00	1.66
3	600312	平高电气	159，000	3，590，220.00	1.11
4	300144	宋城演艺	63，250	3，583，745.00	1.10
5	601311	骆驼股份	121，100	3，415，020.00	1.05
6	002191	劲嘉股份	172，200	3，309，684.00	1.02
7	300291	华录百纳	75，580	2，853，900.80	0.88
8	600978	宜华木业	122，380	2，746，207.20	0.85
9	002440	闰土股份	109，258	2，618，914.26	0.81
10	600826	兰生股份	65，745	2，539，729.35	0.78

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	002329	皇氏集团	56，100	3，239，775.00	1.00
2	002367	康力电梯	87，900	2，504，271.00	0.77
3	600115	东方航空	128，500	1，583，120.00	0.49
4	000002	万科A	101，800	1，478，136.00	0.46
5	600742	一汽富维	42，100	1，283，208.00	0.40

5.5 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	23，249.60	0.01
8	其他	-	-
9	合计	23，249.60	0.01

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

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	110031	航信转债	160	23，249.60	0.01

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。

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	138，624.94
2	应收证券清算款	24，107，538.25
3	应收股利	-
4	应收利息	8，739.80
5	应收申购款	3，273，708.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27，528，611.50

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	600645	中源协和	5，958，434.00	1.84	筹划重大事项
2	002183	怡亚通	5，398，470.00	1.66	筹划重大事项
3	600312	平高电气	3，590，220.00	1.11	筹划重大事项
4	300144	宋城演艺	3，583，745.00	1.10	筹划重大事项
5	601311	骆驼股份	3，415，020.00	1.05	筹划重大事项
6	002191	劲嘉股份	3，309，684.00	1.02	筹划重大事项
7	300291	华录百纳	2，853，900.80	0.88	筹划重大事项
8	600978	宜华木业	2，746，207.20	0.85	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

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	002329	皇氏集团	3，239，775.00	1.00	筹划重大事项
2	002367	康力电梯	2，504，271.00	0.77	筹划重大事项

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	152，550，609.53
报告期期间基金总申购份额	281，266，202.93
减：报告期期间基金总赎回份额	296，302，422.18
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	137，514，390.28

§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	3，333.00
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	3，333.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-

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中证500指数增强型证券投资基金（LOF）的文件

2、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同

3、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）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500指数增强型证券投资基金（LOF）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

富国中证国有企业改革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：	中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	富国中证国企改指数分级		
场内简称	国企改革		
基金主代码	161026		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年12月17日		
报告期末基金份额总额	63，248，754，051.15		
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证国有企业改革指数。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，按照成份股在中证国有企业改革指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证国有企业改革指数的收益表现，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%×中证国有企业改革指数收益率+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。从本基金所分离的两类基金份额来看，富国国企改革A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；富国国企改革B份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	国企改A	国企改B	富国中证国企改指数分级
下属分级基金场内简称	国企改A	国企改B	国企改革
下属分级基金的交易代码	150209	150210	161026
报告期末下属分级基金的份额总额（单位：份）	20，844，445，601.50	20，844，445，601.50	21，559，862，848.15
下属分级基金的风险收益特征	富国国企改革A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征。	富国国企改革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	1，274，993，571.63
2.本期利润	-3，760，604，451.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1437
4.期末基金资产净值	56，044，239，485.26
5.期末基金份额净值	0.886

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。

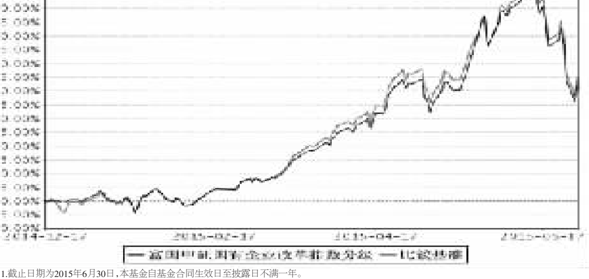
3.2 基金净值表现

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	18.98%	2.70%	19.38%	2.70%	-0.40%	0.00%

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，本基金自基金合同生效日至披露日不满一年。

2.本基金于2014年12月17日成立，建仓期6个月，从2014年12月17日至2015年6月16日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.3 其他指标

其他指标	报告期末（2015年06月30日）
国企改A与国企改B基金份额配比	1:1
期末国企改A份额参考净值	1.006
期末国企改A份额累计参考净值	1.031
期末国企改B份额参考净值	0.766
期末国企改B份额累计参考净值	1.908
2015年富国国企改A的预计年收益率	5.75%

§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		
王保合	本基金基金经理兼任量化投资总监、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证移动互联网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基金经理	2015-04-15		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，2015年4月起任富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金经理，2015年5月起任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基金经理；兼任量化投资总监。具有基金从业资格。
张圣贤	本基金基金经理兼任富国中证军工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	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	2014-12-17	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中证国有企业改革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》、《富国中证国有企业改革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，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10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，中证国企改革指数二季度整体上涨20.34%。

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，本基金净值增长率18.98%，同期业绩比较基准收益率为19.38%。

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	50，883，481，285.46	88.87
	其中：股票	50，883，481，285.46	88.87
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	5，930，021，495.36	10.36
7	其他资产	442，042，278.93	0.77
8	合计	57，255，545，059.75	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	250，463，743.54	0.45
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	240，380.00	-
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	250，704，123.54	0.45

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	1，627，290，360.62	2.90
C	制造业	21，529，490，884.02	38.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1，674，747，170.46	2.99
E	建筑业	2，563，341，041.88	4.57
F	批发和零售业	4，693，414，441.81	8.37
G	交通运输、仓储和邮政业	3，035，654，622.78	5.42
H	住宿和餐饮业	187，617，015.40	0.33
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3，834，015，900.83	6.84
J	金融业	5，533，720，465.40	9.87
K	房地产业	1，703，589，657.42	3.04
L	租赁和商务服务业	1，973，257，166.33	3.52
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	1，915，538，237.01	3.42
S	综合	361，100，197.96	0.64
	合计	50，632，777，161.92	90.34

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	000768	中航飞机	42，938，800	1，871，272，904.00	3.34
2	601328	交通银行	212，409，773	1，750，256，529.52	3.12
3	601989	中国重工	104，755，285	1，550，378，218.00	2.77
4	601669	中国电建	132，891，080	1，506，984，847.20	2.69
5	000728	国元证券	38，133，018	1，448，292，023.64	2.58
6	600050	中国联通	195，931，606	1，436，178，671.98	2.56
7	600637	东方明珠	29，621，796	1，246，485，175.68	2.22
8	600839	四川长虹	119，516，660	1，176，043，934.40	2.10
9	601106	中国一重	84，635，226	1，024，932，586.86	1.83
10	600009	上海机场	31，175，819	988，273，462.30	1.76

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	600872	中炬高新	11，584，817	250，463，743.54	0.45
2	601211	国泰君安	7，000	240，380.00	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	6，971，022.68
2	应收证券清算款	49，004，018.95
3	应收股利	-
4	应收利息	1，081，608.13
5	应收申购款	384，985，629.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	442，042，278.93

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指数股票中未持有流通受限的股票。

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

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	600872	中炬高新	250，463，743.54	0.45	筹划重大事项

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	国企改A	国企改B	富国中证国企改指数分级
报告期期初基金份额总额	2，849，600，684.00	2，849，600，684.00	4，708，033，361.34
报告期期间基金总申购份额	-	-	58，455，812，435.63
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-	14，306，862，856.56
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	17，994，844，917.50	17，994，844，917.50	-27，297，120，092.26
报告期期末基金份额总额	20，844，445，601.50	20，844，445，601.50	21，559，862，848.15

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及份额折算的份额。

§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	50，001，250.00
报告期期间买入/申购总份额	29，167，599.77
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	79，168，849.77
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.13

7.2 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
1	份额折算	2015-05-26	29，167，599.77	-	-
合计			29，167，599.77	-	

§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国有企业改革指数分级证券投资基金的文件

2、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金基金合同

3、富国中证国有企业改革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、富国中证国有企业改革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

富国医疗保健行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	富国医疗保健行业股票
基金主代码	000220
交易代码	前端交易代码：000220 后端交易代码：000565
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年08月07日
报告期末基金份额总额（单位：份）	517，944，552.91
投资目标	本基金主要投资于医疗保健行业股票，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	中证医药卫生指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期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

§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	398，487，185.23
2.本期利润	305，268，206.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.5262
4.期末基金资产净值	1，308，263，388.96
5.期末基金份额净值	2.526

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。

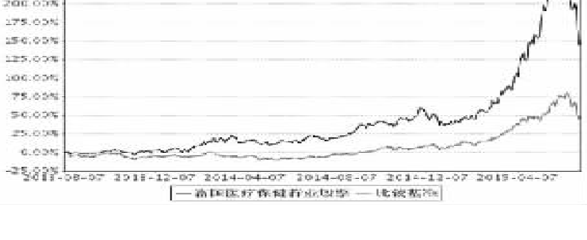
3.2 基金净值表现

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	37.06%	3.26%	16.33%	2.26%	20.73%	1.00%

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2013年08月07日成立，本基金建仓期6个月，即从2013年08月07日至2014年02月06日止，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		
戴益强	本基金基金经理兼任富国消费主题混合型证券投资基金基金经理	2013-08-07		8年	硕士，曾任易方达基金管理有限公司行业研究员；2008年9月至2012年10月任富国基金管理有限公司行业研究员，2012年10月至2014年1月任汉盛证券投资基金基金经理，2013年8月起任富国医疗保健行业股票型证券投资基金基金经理，2014年1月起任汉兴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医疗保健行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》、《富国医疗保健行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14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

二季度内市场波动巨大，4、5月市场整体大幅上涨，6月开始进入巨幅调整。我们认为本轮调整剧烈的原因是去杠杆，因此对判断底部也有重要的参考意义。本基金季度内前期重点配置了基因测序、互联网医疗相关的个股，后期降低了仓位。

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37.06%，同期业绩比较基准收益率为16.33%。

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	1，071，379，350.12	60.25
	其中：股票	1，071，379，350.12	60.25
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	673，555，490.31	37.88
7	其他资产	33，242，029.65	1.87
8	合计	1，778，176，870.08	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	493，696，754.44	37.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	220，393.35	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	334，278，570.87	25.55
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	193，369，881.98	14.78
J	金融业	36，576.72	-
K	房地产业	1，474，679.20	0.11
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	79，418.20	0.01
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	48，223，075.36	3.69
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1，071，379，350.12	81.89

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	300341	麦迪电气	4，211，395	126，678，761.60	9.68
2	600195	中牧股份	4，354，274	122，355，099.40	9.35
3	600511	国药股份	2，344，299	118，129，226.61	9.03
4	600420	现代制药	2，529，192	110，019，852.00	8.41
5	600833	第一医药	4，365，096	100，397，208.00	7.67
6	300253	卫宁软件	1，647，607	85，675，564.00	6.55
7	300287	飞利信	2，120，000	80，729，600.00	6.17
8	600713	南京医药	3，464，000	56，809，600.00	4.34
9	000705	浙江震元	3，291，956	54，679，389.16	4.18
10	600594	益佰制药	901，549	52，407，043.37	4.01

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。

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。

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	3，099，961.82
2	应收证券清算款	30，040，024.00
3	应收股利	-
4	应收利息	102，043.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33，242，029.65

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	300287	飞利信	80，729，600.00	6.17	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	267，764，509.35
报告期期间基金总申购份额	857，002，754.22
减：报告期期间基金总赎回份额	606，822，710.66
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	517，944，552.91

§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医疗保健行业股票型证券投资基金的文件

2、富国医疗保健行业股票型证券投资基金基金合同

3、富国医疗保健行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、富国医疗保健行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