富国国有企业债债券型证券投资基金

2015 半年度报告摘要

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
送出日期:	2015年08月27日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国国有企业债债券		
基金主代码	000139		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年09月25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		
报告期末基金份额总额	341,485,900.53份		
基金合同存续期	不定期		
下属两级基金的基金简称	富国国有企业债债券A/B		富国国有企业债债券C
下属两级基金的交易代码	前端	后端	000141
报告期末下属两级基金的份额总额	289,299,821.60份		52,186,078.93份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以国有企业债为主要投资对象,合理控制信用风险,在追求本金安全的基础上进行积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳定增值。
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。在认真研究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	中证信用债指数
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	林葛
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层中国农业银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

§3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

(1)富国国有企业债债券A/B

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	报告期(2015年01月01日至2015年06月30日)
本期已实现收益	13,741,600.45
本期利润	14,122,747.57
加权平均基金份额本期利润	0.0504
本期基金份额净值增长率	5.11%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2015年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0118
期末基金资产净值	292727928.96
期末基金份额净值	1.012

(2)富国国有企业债债券C

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	报告期(2015年01月01日至2015年06月30日)
本期已实现收益	1,726,800.01
本期利润	1,811,868.34
加权平均基金份额本期利润	0.0442
本期基金份额净值增长率	4.94%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2015年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0085
期末基金资产净值	52,629,855.14
期末基金份额净值	1.009

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 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)富国国有企业债债券A/B

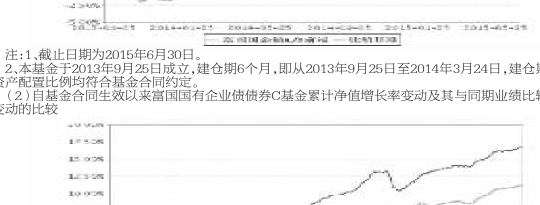
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.59%	0.05%	0.55%	0.03%	0.04%	0.02%
过去三个月	2.39%	0.07%	2.35%	0.05%	0.04%	0.02%
过去六个月	5.11%	0.07%	3.81%	0.07%	1.30%	0.00%
过去一年	8.92%	0.11%	7.87%	0.10%	1.05%	0.01%
自基金合同生效日起至今	16.79%	0.09%	11.24%	0.09%	5.55%	0.00%

(2)富国国有企业债债券C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.60%	0.06%	0.55%	0.03%	0.05%	0.03%
过去三个月	2.31%	0.07%	2.35%	0.05%	-0.04%	0.02%
过去六个月	4.94%	0.07%	3.81%	0.07%	1.13%	0.00%
过去一年	8.44%	0.11%	7.87%	0.10%	0.57%	0.01%
自基金合同生效日起至今	15.95%	0.09%	11.24%	0.09%	4.71%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

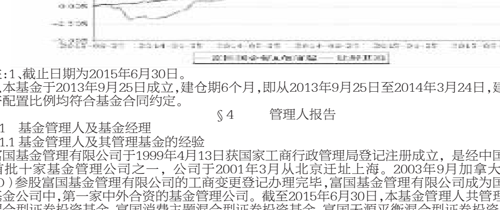
(1)自基金合同生效以来富国国有企业债债券A/B基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、截止日期为2015年6月30日。

2、本基金于2013年9月25日成立,建仓期6个月,即从2013年9月25日至2014年3月24日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

(2)自基金合同生效以来富国国有企业债债券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:1、截止日期为2015年6月30日。

2、本基金于2013年9月25日成立,建仓期6个月,即从2013年9月25日至2014年3月24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 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于1999年4月13日获国家工商行政管理局登记注册成立,是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一,公司于2001年3月从北京迁址上海。2003年9月加拿大蒙特利尔银行(BMO)参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕,富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中,第一家中外合资的基金管理公司。截至2015年6月30日,本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国消费主题混合型证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金(LOF)、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天博创新主题股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金(LOF)、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深300增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金、富国汇利回报分级债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈债券型证券投资基金(LOF)、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业股票型证券投资基金、富国中国中小盘(香港上市)股票型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国信用增强债券型证券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国医疗保健行业股票型证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国恒利分级债券型证券投资基金、富国城镇发展股票型证券投资基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金、富国收益增强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、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、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、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、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、富国收益宝货币市场基金、富国中小盘精选混合型证券投资基金、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金、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、富国文体健康股票型证券投资基金、富国国家安全主题混合型证券投资基金、富国改革动力混合型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国中证工业4.0指数分级证券投资基金、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育指数分级证券投资基金等六十四只证券投资基金。

4.1.2 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)、富国产业债债券型证券投资基金、富国信用增强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	2014-10-25	-	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。
方芳	本基金经理	2015-01-29	-	5年	硕士,自2011年3月至2013年3月在宏源证券任信用债分析员;自2013年4月至2015年1月在富国基金管理有限公司任债券研究员,2015年1月起任富国国有企业债债券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决定确定的聘任日期,离任日期为根据公司决定确定的解聘日期;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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为富国国有企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》、《富国国有企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,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对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

上半年债券市场有所反复,1季度在流动性宽松和对经济基本面的担忧下,债市走势流畅。2季度虽然有持续的降准和降息,短端利率大幅度下行,但债市表现胶着,成交不活跃,尤其是长端。主要原因是数以万亿计的置换债上市使得市场对长久期债券的供给产生担忧,而对稳增长的预期不断改善。同时,由于股市急速拉升,财富效应明显,债市缺乏新增资金的推动。

本组合保持了较低的杠杆以备赎回,但在横盘调整中择机买入了一些性价比较好的个券,运作期间业绩稳定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金A/B级份额净值为1.012元,份额累计净值为1.159元;本基金C级份额净值为1.009元,份额累计净值为1.151元。本报告期,本基金A/B级份额净值增长率为5.11%,C级份额净值增长率为4.94%;A/B级同期业绩比较基准收益率为3.81%,C级同期业绩比较基准收益率为3.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们认为全球经济的恢复仍然是缓慢而艰难的,通胀低位徘徊,避险需求持续存在。我国的降杠杆的趋势不改,融资需求体量最大的主体如地方政府,房地产等的信用扩张能力受限,三期叠加的过程中货币政策不具备收缩的动能。并且,股市在经历了20多万亿的市值蒸发之后,全社会的风险偏好,尤其是机构的,将向下调整,部分原权益类资产有望转投债券。由此,陡峭化的收益率曲线有望向下收敛,债市仍然会有积极的表现。同时,我们也关注到几个风险点,可能在四季度发酵:一是美元加息预期临近,人民币汇率的稳定性将影响到货币政策宽松的幅度。二是无论产业债还是城投债,信用风险都有放大的趋势,对于有瑕疵的个券务必提高警惕,及时出库。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会,并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关,由主管运营副总经理负责,成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理,所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作,保证基金估值的公允性和合理性,维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员,必须列席估值委员会的定期会议,提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题,参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于2015年01月14日公告对2014年内利润进行第十次收益分配, 每10份A\B级基金份额派发红利0.14元,每10份C级基金份额派发红利0.14元,共计派发红利4169840.02元。

本基金对本报告期内利润进行的收益分配如下:2015年2月11日公告每10份A\B级基金份额派发红利0.15元, 每10份C级基金份额派发红利0.15元;2015年3月12日公告每10份A\B级基金份额派发红利0.11元,每10份C级基金份额派发红利0.11元;2015年4月13日公告每10份A\B级基金份额派发红利0.07元,每10份C级基金份额派发红利0.07元;2015年5月15日公告每10份A\B级基金份额派发红利0.10元, 每10份C级基金份额派发红利0.05元;2015年6月12日公告每10份A\B级基金份额派发红利0.09元,每10份C级基金份额派发红利0.09元;2015年7月15日公告每10份A\B级基金份额派发红利0.07元,每10份C级基金份额派发红利0.07元。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司本报告期基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为, 富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:富国国有企业债债券型证券投资基金

报告截止日:2015年06月30日

单位:人民币元

资 产	本期末(2015年06月30日)	上年度末(2014年12月31日)
资 产:		
银行存款	12,955,454.57	563,132.99
结算备付金	2,323,683.44	25,518,252.54
存出保证金	63,340.94	24,928.79
交易性金融资产	372,024,688.98	463,099,903.29
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	372,024,688.98	463,099,903.29
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	3,081,004.48
应收利息	8,110,347.01	13,459,896.51
应收股利	-	-
应收申购款	2,984,291.64	28,990.08
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	398,461,806.58	505,776,108.68
负债和所有者权益	本期末(2015年06月30日)	上年度末(2014年12月31日)
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	52,000,000.00	200,225,909.30
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	631,743.46	187,039.09
应付管理人报酬	195,212.79	221,097.70
应付托管费	55,775.07	63,170.78
应付销售服务费	15,812.76	10,854.86
应付交易费用	550.00	2,012.45
应交税费	2,156.88	2,156.88
应付利息	18,301.08	4,627.37
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	184,470.44	190,367.08
负债合计	53,104,022.48	200,907,235.51
所有者权益:		
实收基金	341,485,900.53	296,891,341.39
未分配利润	3,871,883.57	7,977,531.78
所有者权益合计	345,357,784.10	304,868,873.17
负债和所有者权益总计	398,461,806.58	505,776,108.68

注:报告截止日2015年06月30日,基金份额净值1.011元,基金份额总额341,485,900.53份。其中:富国国企债A/B份额净值1.012元,份额总额289,299,821.60份;富国国企债C份额净值1.009元,份额总额52,186,078.93份。

6.2 利润表

会计主体:富国国有企业债债券型证券投资基金

本报告期:2015年01月01日至2015年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期(2015年01月01日至2015年06月30日)	上年度可比期间(2014年01月01日至2014年06月30日)
一、收入	18,781,134.78	37,464,709.93
1.利息收入	10,871,190.48	21,783,941.48
其中:存款利息收入	117,575.04	2,813,049.57
债券利息收入	10,740,721.78	18,846,536.56
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	12,893.66	124,355.35
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	7,432,578.66	7,142,509.68
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7,432,578.66	7,142,509.68
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具投资收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	466,215.45	8,529,335.64
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	11,150.19	8,923.13
减:二、费用	2,846,518.87	8,458,278.30
1. 管理人报酬	1,136,148.61	1,374,292.06
2. 托管费	324,613.89	392,654.91
3. 销售服务费	82,455.35	55,192.58
4. 交易费用	7,741.88	13,371.66
5. 利息支出	1,135,315.48	6,494,954.13
其中:卖出回购金融资产支出	1,135,315.48	6,494,954.13
6. 其他费用	160,243.66	127,812.96
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	15,934,615.91	29,006,431.63
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	15,934,615.91	29,006,431.63

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富国国有企业债债券型证券投资基金

本报告期:2015年01月01日至2015年06月30日

单位:人民币元

项目	本期(2015年01月01日至2015年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	296,891,341.39	7,977,531.78	304,868,873.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,934,615.91	15,934,615.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	44,594,559.14	870,486.41	45,465,045.55
其中:1.基金申购款	125,246,114.88	2,060,500.99	127,306,615.87
2.基金赎回款	-80,651,555.74	-1,190,014.58	-81,841,570.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-20,910,750.53	-20,910,750.53
五、期末所有者权益(基金净值)	341,485,900.53	3,871,883.57	345,357,784.10
项目	上年度可比期间(2014年01月01日至2014年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	123,747,084.20	936,420.93	124,683,505.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	29,006,431.63	29,006,431.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	370,272,301.81	2,638,970.02	372,911,271.83
其中:1.基金申购款	455,508,222.82	3,694,658.18	459,202,881.00
2.基金赎回款	-85,235,921.01	-1,055,688.16	-86,291,609.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-14,701,911.35	-14,701,911.35
五、期末所有者权益(基金净值)	494,019,386.01	17,879,911.23	511899297.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

陈 戈 林志松 雷青松

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国国有企业债债券型证券投资基金 (以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2013]205号文《关于核准富国国有企业债债券型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2013年9月25日正式生效,首次设立募集规模为313,323,291.52份基金份额,其中A/B类121,099,112.46份,C类192,224,179.06份。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为A类;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,在投资者赎回时收取后端认购/申购费用、赎回费用的基金份额,称为B类。从本类别基金资产中提取销售服务费、不收取认购/申购费用,但对持有期限少于30日的本类别基金份额的赎回收取赎回费的基金份额,称为C类。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不参与一级市场的新股申购或股票增发,也不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%,其中对国有企业债的投资比例不低于固定收益类资产的80%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为中证信用债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下文6.4.5.2会计估计变更的说明中的变更外,本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定, 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

2.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

根据证监许可[2015]95号《关于核准设立申万宏源证券有限公司及其2家子公司的批复》的批准,中国证券监督管理委员会同意申银万国证券股份有限公司以吸收合并宏源证券股份有限公司后的全部证券类资产及负债出资设立全资子公司申万宏源证券有限公司。相应的,本公司的股东自2015年1月16日起由申银万国证券股份有限公司变更为申万宏源证券有限公司。相关变更手续尚在办理当中。变更后,本公司的股东为海通证券股份有限公司,出资比例为27.775%;申万宏源证券有限公司,出资比例为27.775%;蒙特利尔银行,出资比例为27.775%;山东省国际信托有限公司,出资比例为16.675%。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司("农业银行")	基金托管人、基金代销机构

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.4 回购交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期(2015年01月01日至2015年06月30日)	上年度可比期间(2014年01月01日至2014年06月30日)
当期发生的基金应支付的管理费	1,136,148.61	1,374,292.06
其中:支付销售机构的客户维护费	84,905.60	119,921.56

注:基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E× 0.7%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期(2015年01月01日至2015年06月30日)	上年度可比期间(2014年01月01日至2014年06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	324,613.89	392654.91

注:基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

6.4.8.2.3 销售服务费

金额单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期(2015年01月01日至2015年06月30日)		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A/B级	C级	合计
富国基金管理有限公司	-	54,488.35	54,488.35
合计	-	54,488.35	54,488.35

金额单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间(2014年01月01日至2014年06月30日)		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A/B级	C级	合计
富国基金管理有限公司	-	55,192.58	55,192.58
合计	-	55,192.58	55,192.58

注: 本基金A、B类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费将专门用于本基金C类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

在通常情况下,销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下:

H=E×基金销售服务费年费率÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。

本基金合同生效日为2013年9月25日,无上年度同期对比数据。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本报告期末及上年度可比期间末本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本报告期末及上年度可比期间末本基金除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期(2015年01月01日至2015年06月30日)		上年度可比期间(2014年01月01日至2014年06月30日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	12,955,454.57	28,786.57	480,319.23	41,058.63

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

6.4.9 利润分配情况

富国国有企业债债券A/B:

单位:人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放	再投资形式发放	利润分配合计	备注
1	2015-01-19	2015-01-20	0.140	3,827,789.99	53,174.45	3,880,964.44	-
2	2015-02-13	2015-02-16	0.150	4,097,858.40	68,783.46	4,166,641.86	-
3	2015-03-16	2015-03-17	0.110	3,051,739.91	54,469.37	3,106,209.28	-
4	2015-04-15	2015-04-16	0.070	1,868,048.75	26,900.16	1,894,948.91	-
5	2015-05-18	2015-05-19	0.100	2,801,828.55	65,822.64	2,867,651.19	-
6	2015-06-16	2015-06-17	0.090	2,518,007.18	59,986.46	2,577,993.64	-
合 计			0.660	18,165,272.78	329,136.54	18,494,409.32	-

富国国有企业债债券C:

单位:人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放	再投资形式发放	利润分配合计	备注
1	2015-01-19	2015-01-20	0.140	257,084.84	31,790.74	288,875.58	-
2	2015-02-13	2015-02-16	0.150	552,184.20	144,440.85	696,625.05	-
3	2015-03-16	2015-03-17	0.110	365,696.66	113,236.66	478,933.32	-
4	2015-04-15	2015-04-16	0.070	184,779.91	56,855.32	241,635.23	-
5	2015-05-18	2015-05-19	0.050	246,291.29	41,983.58	288,274.87	-
6	2015-06-16	2015-06-17	0.090	351,579.61	70,417.55	421,997.16	-
合 计			0.610	1,957,616.51	458,724.70	2,416,341.21	-

注:本基金于资产负债表日之后、财务报表批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见资产负债表日后事项(附注6.4.8.2)。

1.1.1 期末(2015年06月30日)本基金持有的流通受限证券

1.1.1.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

1.1.1.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

1.1.1.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

1.1.1.3.1 银行间市场债券正回购

注:截至本报告期末2015年6月30日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

1.1.1.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币52,000,000.00元,于2015年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

1.1.2 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1公允价值

6.4.14.1.1不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债, 其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1各层次金融工具公允价值

于2015年6月30日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币0.00元,属于第二层次的余额为人民币372,024,688.98元,属于第三层次余额为人民币0.00元。

6.4.14.1.2.2公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.1.2.3第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.14.2承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§2 投资组合报告

2.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	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	372,024,688.98	93.37
	其中:债券	372,024,688.98	93.37
	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	15,279,138.01	3.83
7	其他各项资产	11,157,979.59	2.80
8	合计	398,461,806.58	100.00

2.2 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。

2.3 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。

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的半年度报告正文

2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

2.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:本基金本报告期无股票交易。

2.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:本基金本报告期无股票交易。

2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本基金本报告期无股票交易。

2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,102,000.00	5.82
	其中:政策性金融债	20,102,000.00	5.82
4	企业债券	351,922,688.98	101.90
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	372,024,688.98	107.72

2.6 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

金额单位:人民币元

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	124987	14昆经开	289,990	29,906,668.70	8.66
2	112143	12粤电01	279,526	28,841,492.68	8.35
3	1180085	11晨鸣控股债	200,000	20,306,000.00	5.88
4	122961	09武城投	150,000	15,484,500.00	4.48
5	122840	11临汾债	127,920	13,379,152.80	3.87

2.7 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。

2.8 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。

2.9 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。

2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

2.10.1 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。

2.10.2 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。

2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

2.11.1 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。

2.11.2 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。

2.11.3 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。

2.12 投资组合报告附注

2.12.1 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。

2.12.2 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。

本基金本报告期末未持有股票。

2.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	63,340.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,110,347.01
5	应收申购款	2,984,291.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,157,979.59

2.12.4 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。

2.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

2.12.6 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。

§3 基金份额持有人信息

3.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
富国国有企业债债券A/B	1226	235,970.49	260,577,256.98	90.07	28,722,564.62	9.93
富国国有企业债债券C	724	72,080.22	34,869,591.76	66.82	17,316,487.17	33.18
合计	1950	175,120.97	295,446,848.74	86.52	46,039,051.79	13.48

3.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	富国国有企业债债券A/B	10,451.67	0.0036
	富国国有企业债债券C	-	-
	合计	10,451.67	0.0031

3.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	富国国有企业债债券A/B	0
	富国国有企业债债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富国国有企业债债券A/B	0
	富国国有企业债债券C	0
	合计	0

§4 开放式基金份额变动

单位:份

	富国国有企业债债券A/B	富国国有企业债债券C
基金合同生效日(2013年09月25日)基金份额总额	121,099,112.46	192,224,179.06
报告期期初基金份额总额	277,200,339.92	19,691,001.47
本报告期基金总申购份额	46,654,144.81	78,591,970.07
减:本报告期基金总赎回份额	34,554,663.13	46,096,892.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	289,299,821.60	52,186,078.93

§5 重大事件揭示

5.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

5.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期内,本基金管理人已于2015年1月10日发布公告,李笑薇女士、朱少醒先生自2015年1月9日起担任公司副总经理。

本基金管理人已于2015年1月31日发布公告,薛爱东先生自2015年1月30日起担任公司董事长。

5.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

5.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

5.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

5.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

1.1

5.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
西部证券	1	-	0.00	-	0.00	-	0.00	-	0.00	-	0.00	
兴业证券	2	-	0.00	111,022,757.84	12.78	1,760,488,000.00	24.05	-	0.00	-	0.00	
中金公司	1	-	0.00	83,320,875.11	9.60	1,278,700,000.00	17.47	-	0.00	-	0.00	
中信证券	2	-	0.00	561,059,880.56	64.60	3,222,825,000.00	44.03	-	0.00	-	0.00	
中银国际	1	-	0.00	113,083,896.82	13.02	1,057,281,000.00	14.45	-	0.00	-	0.00	

注:1.我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

2.本期内本基金租用的券商交易单元无变更。