

富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

监管机构。2、季度公平性交易分析报告按照经基金经理或投资经理签字，并经督察员、总经理审阅签字后，归档备查，以备查。

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超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4报告期内本基金投资策略和运作分析
富国两年期纯债2季度净值增长3.20%，超过业绩基准。本季度内，央行进行了两次降息、一次全面降准和一次有条件降准，并陆续调降公开市场逆回购利率，通胀低位运行，债券走势较好。

2015年上半年经济稳增长乏力，通胀低位徘徊，央行多次降准降息以促稳增长、调结构的目標实现。本基金在上半年表现良好，净值稳步上涨。在经历了2014年四季度居民资产配置切换之后，2015年股市对债市的分流已不明显。

4.4.2报告期内基金的业绩表现
截至2015年6月30日，本基金份额净值为1.081元，份额累计净值为1.184元；本报告期，本基金份额净值增长率为6.69%，同期业绩比较基准收益率为2.11%。

4.5管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
往后看，股市波动增大，打新收益也会逐步下降，债券投资处于较为有利的环境。九月，基金将迎来第一次分红，为此本基金将在保持长期投资风格基础上，逐步降低久期，调整仓位，以流动性管理为先，力图为投资者带来稳定回报。

4.6管理人对于报告期内本基金估值程序等事项的说明
本公司按照相关会计准则建立了估值委员会，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》，估值委员会是公司估值的主要决策机构，由主管运营部总经理负责，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，所有相关人员均具有丰富的证券投资基金从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见，提供和评估估值技术，执行估值流程和程序。对外信息披露等工作，保证基金估值的公允性和合理性，维护基金份额持有人的利益。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管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
本基金于2015年6月16日公告对2014年内利润进行第三次收益分配，每10基金份额派发红利0.23元，共计派发红利20164837.09元。

本基金对本报告期内利润进行收益分配如下：2015年4月14日公告每10基金份额派发红利0.30元，共计派发红利26301962.26元。

本基金严格执行按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8报告期内管理人对于本基金持有或形成重大资产净值变动管理情况的说明
本报告期内无需要说明的相关情况。

5 托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵守诚信情况声明
报告期内，中国建设银行股份有限公司在本基金的投资过程中，严格遵守《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2管理人对于报告期内本基金投资运作遵守情况、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议及其他有关规定，对本基金的资金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本基金于2015年01月16日公告对2014年内利润进行第三次收益分配，每10基金份额派发红利0.23元，共计派发红利20164837.09元。

本基金对本报告期内利润进行收益分配如下：2015年4月14日公告每10基金份额派发红利0.30元，共计派发红利26301962.26元。

5.3报告期内，本基金实施利润分配分配总额为44466799.74元。

本托管人于本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人复核审查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。

6.1资产负债报表
会计主体：富国目标收益两年期纯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)
货币资金	30,996,838.93	2,543,672.17
结算备付金	14,749,436.50	41,961,266.86
应收利息	30,006.42	17,212.64
应收股利	1,249,027,793.82	1,486,906,442.41
其他资产	-	-
基金投资	-	-
证券投资	1,241,572,742.82	1,484,690,137.41
资产支持证券投资	8,366,016.00	12,270,356.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	58,000,196.00	1,000,000.00
应收证券清算款	-	19,670,777.92
应收利息	23,242,476.22	43,236,587.61
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
预提费用	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,376,986,731.89	1,606,380,158.51
负债和所有者权益		
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
应付短期融资款	-	-
应付利息	156,244.06	168,436.26
应付管理人报酬	-	-
应付托管费	-	-
应付销售服务费	-	-
应交税费	3,301.76	1,500.00
应付股利	53,336.50	53,336.50
其他负债	69,464.64	-
所有者权益		
实收基金	18,929.52	280,000.00
未分配利润	70,921,700.49	67,146,728.27
所有者权益合计	947,063,369.73	933,078,728.51
负债和所有者权益总计	1,376,986,731.89	1,606,380,158.51

注：报告截止日2015年06月30日，基金份额净值1.081元，基金份额总额76,732,069.24份。

6.2利润表
会计主体：富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金
报告期间：2015年1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	60,562,822.71	30,351,796.47
1.利息收入	43,797,397.93	56,966,406.66
其中：存款利息收入	130,562.41	5,486,514.08
债券利息收入	42,840,805.63	27,202,977.72
资产支持证券投资利息收入	246,423.88	266,173.29
买入返售金融资产利息收入	331,636.11	1,069,430.60
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”号填列)	16,576,638.37	824,279.70
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	16,576,638.37	824,279.70
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	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	10,190,817.41	16,072,021.11
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	9,320,962.76	5,289,779.63
减：二、费用	-	-
1.管理人报酬	929,161.26	896,303.08
2.托管费	-	-
3.销售服务费	10,328.59	9,770.07
4.交易费用	8,221,492.55	4,213,098.18
5.利息支出	8,221,492.55	4,213,098.18
其中：卖出回购金融资产支出	150,380.26	146,353.22
6.其他费用	60,241,980.96	45,586,016.94
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	60,241,980.96	45,586,016.94

6.3所有者权益(基金净值)变动表
会计主体：富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金
报告期间：2015年1月01日至2015年06月30日

单位：人民币元

资产减值准备资产	58,000,190.00	1,000,000.00
应收证券清算款	-	19,676,777.92
应收利息	23,242,476.22	43,236,587.51
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,376,696,731.89	1,606,380,150.51
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	-	-