

富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2015】半年度报告摘要

行情。经一季度的市场调整,投资者风险偏好下行,将更加关注对价格的判断,个股走向分化是必然。4.6管理人认为报告期内基金估值等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.2报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.3报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.4报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.5报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.6报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.7报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.8报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.9报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.10报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.11报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.12报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.13报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.14报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.15报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.16报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.17报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.18报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.19报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.20报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.21报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.22报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

本管理人认为,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投资过程中,严格执行《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,基金投资运作符合基金合同约定。5.23报告期内本基金投资运作遵守程序,净值计算、申购赎回等事宜的说明

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600062	南京高科	8,800	330,264.00	0.17
2	600066	东风汽车	11,000	139,480.00	0.07
3	601872	中伟国际	11,800	133,694.00	0.06
4	601888	中国神华	1,560	90,460.00	0.05
5	601766	兴业银行	5,200	90,472.00	0.05
6	601288	农业银行	22,900	84,360.00	0.04
7	601088	中国神华	15,300	77,262.00	0.04
8	600575	国电电力	13,000	75,960.00	0.04
9	600589	广东东鹏	5,200	56,360.00	0.03
10	600765	中航电机	2,000	54,800.00	0.03

注:投资者需要了解本报告有关基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于富国基金管理有限公司网站半年度报告正文

7.5报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1累计买入金额超过期初基金资产净值5%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601887	中国神华	2,074,324.00	0.90
2	601288	农业银行	1,183,000.00	0.51
3	601088	中国神华	863,728.00	0.43
4	601288	农业银行	800,010.00	0.36
5	600028	中国石化	680,890.00	0.30
6	601166	兴业银行	439,460.00	0.19
7	600000	浦发银行	390,480.00	0.17
8	600036	招商银行	385,500.00	0.17
9	601318	中国平安	369,830.00	0.16
10	601766	兴业银行	365,640.00	0.16
11	601888	中国神华	366,300.00	0.16
12	601390	中国银行	348,520.00	0.15
13	600016	民生银行	346,120.00	0.15
14	601228	交通银行	344,000.00	0.15
15	600519	贵州茅台	326,790.00	0.15
16	601800	中国交建	320,747.00	0.14
17	600000	浦发银行	322,107.00	0.14
18	601818	光大银行	318,220.00	0.14
19	601998	中国银行	291,580.00	0.13
20	600104	上汽集团	290,775.00	0.13

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用

7.5.2累计卖出金额超过期初基金资产净值5%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601887	中国神华	7,150,657.00	3.11
2	601288	农业银行	4,165,550.00	1.81
3	601088	中国神华	2,964,477.00	1.34
4	601628	中国人寿	2,344,530.00	1.05
5	600028	中国石化	2,344,452.42	1.02
6	601166	兴业银行	1,401,265.40	0.62
7	600036	招商银行	1,437,303.00	0.62
8	601318	中国平安	1,405,490.00	0.61
9	600016	民生银行	1,229,858.48	0.53
10	601228	交通银行	1,227,534.46	0.53
11	601018	光大银行	1,163,060.11	0.51
12	601088	中国神华	1,152,256.00	0.50
13	600519	贵州茅台	1,146,202.72	0.50
14	600000	浦发银行	1,109,368.40	0.48
15	600000	浦发银行	1,099,162.71	0.48
16	601390	中国银行	1,045,024.44	0.46
17	601166	兴业银行	1,043,061.69	0.46
18	600104	上汽集团	887,660.48	0.43
19	601800	中国交建	869,570.27	0.42
20	601628	中国人寿	878,622.74	0.38

注:“本期累计卖出金额”按卖出成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用

7.5.3买入成交金额与卖出成交金额相抵后的净额

项目	金额
买入股票成交金额	30,565,274.74
卖出股票成交金额	106,647,018.68

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用

7.6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	国债债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	--	--
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转债	1,463.10	0.00
8	其他	--	--
9	合计	1,463.10	0.00

7.7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	110001	新国债债	10	1,463.10	0.00

7.8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

7.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资

7.10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

7.11报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1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

7.11.2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

7.12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

7.13投资组合报告附注

7.13.1报告期内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

7.13.2报告期内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

7.13.3报告期内本基金投资的前十名股票中是否有在基金合同规定备选股票库之外的股票

7.13.4其他证券投资品种

7.13.5投资组合报告附注的其他文字描述部分

7.13.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

7.13.7投资组合报告附注的其他文字描述部分

7.13.8投资组合报告附注的其他文字描述部分

7.13.9投资组合报告附注的其他文字描述部分

7.13.10投资组合报告附注的其他文字描述部分

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用

7.5报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1累计买入金额超过期初基金资产净值5%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601887	中国神华	2,074,324.00	0.90
2	601288	农业银行	1,183,000.00	0.51
3	601088	中国神华	863,728.00	0.43
4	601288	农业银行	800,010.00	0.36
5	600028	中国石化	680,890.00	0.30
6	601166	兴业银行	439,460.00	0.19
7	600000	浦发银行	390,480.00	0.17
8	600036	招商银行	385,500.00	0.17
9	601318	中国平安	369,830.00	0.16
10	601766	兴业银行	365,640.00	0.16
11	601888	中国神华	366,300.00	0.16
12	601390	中国银行	348,520.00	0.15
13	600016	民生银行	346,120.00	0.15
14	601228	交通银行	344,000.00	0.15
15	600519	贵州茅台	326,790.00	0.15
16	601800	中国交建	320,747.00	0.14
17	600000	浦发银行	322,107.00	0.14
18	601818	光大银行	318,220.00	0.14
19	601998	中国银行	291,580.00	0.13
20	600104	上汽集团	290,775.00	0.13

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用

7.5.2累计卖出金额超过期初基金资产净值5%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601887	中国神华	7,150,657.00	3.11
2	601288	农业银行	4,165,550.00	1.81
3	601088	中国神华	2,964,477.00	1.34
4	601628	中国人寿	2,344,530.00	1.05
5	600028	中国石化	2,344,452.42	1.02
6	601166	兴业银行	1,401,265.40	0.62
7	600036	招商银行	1,437,303.00	0.62
8	601318	中国平安	1,405,490.00	0.61
9	600016	民生银行	1,229,858.48	0.53
10	601228	交通银行	1,227,534.46	0.53
11	601018	光大银行	1,163,060.11	0.51
12	601088	中国神华	1,152,256.00	0.50
13	600519	贵州茅台	1,146,202.72	0.50
14	600000	浦发银行	1,109,368.40	0.48
15	600000	浦发银行	1,099,162.71	0.48
16	601390	中国银行	1,045,024.44	0.46
17	601166	兴业银行	1,043,061.69	0.46
18	600104	上汽集团	887,660.48	0.43
19	601800	中国交建	869,570.27	0.42
20	601628	中国人寿	878,622.74	0.38

注:“本期累计卖出金额”按卖出成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用

7.5.3买入成交金额与卖出成交金额相抵后的净额

项目	金额
买入股票成交金额	30,565,274.74
卖出股票成交金额	106,647,018.68

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用

7.6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	国债债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	--	--
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--