

富国中证银行指数分级证券投资基金

[2015] 第二季度报告

基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期日期	2015年4月1日至2015年6月30日

§ 1 重要提示

基金管理人和基金托管人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法律责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金的基金合同，于2015年7月10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。

基金合同由基金管理人和基金托管人共同签署，对基金合同当事人具有同等的法律约束力。基金合同当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。

基金管理人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法律责任。

基金合同自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 富国中证银行指数分级证券投资基金

场内简称 中证银行

基金主代码 161029

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2015年4月30日

报告期末基金份额 2,527,246,000.00

本基金主要投资于指数基金，紧密跟踪中证银行指数，在正常市场情况下，力争使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。

投资目标 本基金主要采用完全复制法进行投资，依托富国量化平台，利用长期稳定的指数模型和交易成本模型，通过分析在证券投资基金中的组合权重和建模股票投资组合，结合行业、中证银行指数收益表现，根据指数和指数期货以及期权等的变动进行动态调整，本基金力争将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，依托富国量化平台，利用长期稳定的指数模型和交易成本模型，通过分析在证券投资基金中的组合权重和建模股票投资组合，结合行业、中证银行指数收益表现，根据指数和指数期货以及期权等的变动进行动态调整，本基金力争将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%以上银行指数收益+5%银行活期存款利率(税后)

风险收益特征 本基金为股票型基金，具有较高风险特征，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 中国银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 银行A级 银行B级

下属分级基金的场内简称 银行A级 银行B级

下属分级基金的交易代码 150241 150242

报告期末下属分级基金的份额总额 1,610,295,000.00

单位(份) 579,059,515.00

报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

净值增长率 1,369,125,969.00

报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

本期利润 24,019,566.94

2.本期利润 51,360,026.60

3.利润总额 51,360,026.60

4.收入利润总额 51,360,026.60

5.期末基金资产净值 579,059,516.00

6.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

7.期末基金资产净值 579,059,516.00

8.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

9.期末基金资产净值 579,059,516.00

10.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

11.期末基金资产净值 579,059,516.00

12.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

13.期末基金资产净值 579,059,516.00

14.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

15.期末基金资产净值 579,059,516.00

16.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

17.期末基金资产净值 579,059,516.00

18.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

19.期末基金资产净值 579,059,516.00

20.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

21.期末基金资产净值 579,059,516.00

22.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

23.期末基金资产净值 579,059,516.00

24.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

25.期末基金资产净值 579,059,516.00

26.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

27.期末基金资产净值 579,059,516.00

28.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

29.期末基金资产净值 579,059,516.00

30.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

31.期末基金资产净值 579,059,516.00

32.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

33.期末基金资产净值 579,059,516.00

34.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

35.期末基金资产净值 579,059,516.00

36.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

37.期末基金资产净值 579,059,516.00

38.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

39.期末基金资产净值 579,059,516.00

40.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

41.期末基金资产净值 579,059,516.00

42.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

43.期末基金资产净值 579,059,516.00

44.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

45.期末基金资产净值 579,059,516.00

46.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

47.期末基金资产净值 579,059,516.00

48.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

49.期末基金资产净值 579,059,516.00

50.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

51.期末基金资产净值 579,059,516.00

52.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

53.期末基金资产净值 579,059,516.00

54.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

55.期末基金资产净值 579,059,516.00

56.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

57.期末基金资产净值 579,059,516.00

58.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

59.期末基金资产净值 579,059,516.00

60.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

61.期末基金资产净值 579,059,516.00

62.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

63.期末基金资产净值 579,059,516.00

64.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

65.期末基金资产净值 579,059,516.00

66.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

67.期末基金资产净值 579,059,516.00

68.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

69.期末基金资产净值 579,059,516.00

70.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

71.期末基金资产净值 579,059,516.00

72.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

73.期末基金资产净值 579,059,516.00

74.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

75.期末基金资产净值 579,059,516.00

76.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

77.期末基金资产净值 579,059,516.00

78.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

79.期末基金资产净值 579,059,516.00

80.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

81.期末基金资产净值 579,059,516.00

82.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

83.期末基金资产净值 579,059,516.00

84.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579,059,516.00

85.期末基金资产净值 579,059,516.00

86.报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) 579