

# 富国消费主题混合型证券投资基金

## 【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：交通银行股份有限公司
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。基金托管人交通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。本报告日期为2015年4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	富国消费主题混合
场内简称	富国消费
基金代码	519015
交易代码	519015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月12日
报告期末基金份额总额(单位:万)	1,825,379,491.86
投资目标	本基金主要投资于大消费行业中具有持续增长潜力的优质上市公司，以分享中国经济增长与结构转型带来的投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用“自上而下”的方法对大类资产配置，侧重对宏观经济、市场、政策等因素进行定量与定性相结合的分析和研究，确定组合中股票、债券、货币衍生品及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于纯债券基金与货币市场基金，低于股票型基金。属于中高风险收益和预期风险水平的投资品种。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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	1,336,858,226.49
2.本期利润	665,269,529.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.0228
4.期末基金份额净值	2,837,245,766.88
5.期末基金资产净值	1,540

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)计入费用后实际收益水平低于所列数字。

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。

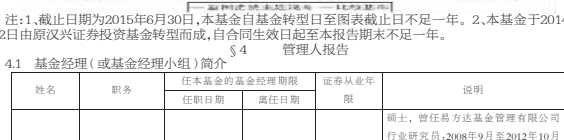
3.2 基金净值表现

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	净值增长率比较基准②	业绩比较基准③	①-②	①-③	②-③
过去三个月	17.46%	2.96%	9.12%	2.69%	8.34%	0.87%

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，本基金自基金转型日至至报告期末不足一年。2.本基金于2014年12月12日由原汉兴证券投资基金转型而成，自合同生效日起至报告期末不足一年。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
王健	基金经理	2014年12月12日	10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11月任民生证券资产管理部研究员，2014年12月起任富国消费主题混合基金基金经理。2014年12月起任富国消费主题混合基金基金经理。

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消费主题混合型证券投资基金的基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国消费主题混合型证券投资基金合同》以及其他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，以保护基金份额持有人利益，确保基金资产的安全并谋求基金资产的长期稳定增值为目标，基金投资组合符合有关法律法规的规定。

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律法规要求，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，并持续组合的独立投资决策。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公平交易制度主要指组合间同一投资标的的相近交易日的同向交易和反向交易的合理性评估，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组合进行事后分析，分析数据涵盖基金、基金、社保及专户产品，并重点分析同类别(股票型、混合型、债券型)间、不同产品间以及同一基金投资组合内不同交易策略的基金组合、交易策略交易行为，监测稽核系统情况要求相关当事人做出合理解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2.季度公平性交易分析稽核系统稽核投资组合的公平性交易，并检查基金经理、总经理审阅报告后，予以保留。以事后监督。本报告期内公平交易制度执行情况良好，未发现异常交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，本基金仓位维持高位，4、5月市场波动较大，6月开始进入巨幅调整。我们认为本轮调整加剧的原因在于杠杆杆，因此对市场的看法也有重要的参考价值。本基金季度内中期重点配置了国家政策支持的方向，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17.46%，同期业绩比较基准收益率为9.12%。

4.6 报告期内管理人对本基金持有人人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期无需说明的相关情况。

§5 投资组合报告	
序号	项目
1	权益投资
2	固定收益投资
3	货币市场工具
4	金融衍生品投资
5	其他资产
6	银行存款和结算备付金合计
7	其他资产
8	合计

§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	14,677,390.36
2.本期利润	15,127,762.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0232
4.期末基金份额净值	440,029,629.52
5.期末基金资产净值	1,016
6.期末基金份额净值	1,016
7.期末基金份额净值	1,016
8.期末基金份额净值	1,016
9.期末基金份额净值	1,016
10.期末基金份额净值	1,016
11.期末基金份额净值	1,016
12.期末基金份额净值	1,016
13.期末基金份额净值	1,016
14.期末基金份额净值	1,016
15.期末基金份额净值	1,016
16.期末基金份额净值	1,016
17.期末基金份额净值	1,016
18.期末基金份额净值	1,016
19.期末基金份额净值	1,016
20.期末基金份额净值	1,016
21.期末基金份额净值	1,016
22.期末基金份额净值	1,016
23.期末基金份额净值	1,016
24.期末基金份额净值	1,016
25.期末基金份额净值	1,016
26.期末基金份额净值	1,016
27.期末基金份额净值	1,016
28.期末基金份额净值	1,016
29.期末基金份额净值	1,016
30.期末基金份额净值	1,016
31.期末基金份额净值	1,016
32.期末基金份额净值	1,016
33.期末基金份额净值	1,016
34.期末基金份额净值	1,016
35.期末基金份额净值	1,016
36.期末基金份额净值	1,016
37.期末基金份额净值	1,016
38.期末基金份额净值	1,016
39.期末基金份额净值	1,016
40.期末基金份额净值	1,016
41.期末基金份额净值	1,016
42.期末基金份额净值	1,016
43.期末基金份额净值	1,016
44.期末基金份额净值	1,016
45.期末基金份额净值	1,016
46.期末基金份额净值	1,016
47.期末基金份额净值	1,016
48.期末基金份额净值	1,016
49.期末基金份额净值	1,016
50.期末基金份额净值	1,016
51.期末基金份额净值	1,016
52.期末基金份额净值	1,016
53.期末基金份额净值	1,016
54.期末基金份额净值	1,016
55.期末基金份额净值	1,016
56.期末基金份额净值	1,016
57.期末基金份额净值	1,016
58.期末基金份额净值	1,016
59.期末基金份额净值	1,016
60.期末基金份额净值	1,016
61.期末基金份额净值	1,016
62.期末基金份额净值	1,016
63.期末基金份额净值	1,016
64.期末基金份额净值	1,016
65.期末基金份额净值	1,016
66.期末基金份额净值	1,016
67.期末基金份额净值	1,016
68.期末基金份额净值	1,016
69.期末基金份额净值	1,016
70.期末基金份额净值	1,016
71.期末基金份额净值	1,016
72.期末基金份额净值	1,016
73.期末基金份额净值	1,016
74.期末基金份额净值	1,016
75.期末基金份额净值	1,016
76.期末基金份额净值	1,016
77.期末基金份额净值	1,016
78.期末基金份额净值	1,016
79.期末基金份额净值	1,016
80.期末基金份额净值	1,016
81.期末基金份额净值	1,016
82.期末基金份额净值	1,016
83.期末基金份额净值	1,016
84.期末基金份额净值	1,016
85.期末基金份额净值	1,016
86.期末基金份额净值	1,016
87.期末基金份额净值	1,016
88.期末基金份额净值	1,016
89.期末基金份额净值	1,016
90.期末基金份额净值	1,016
91.期末基金份额净值	1,016
92.期末基金份额净值	1,016
93.期末基金份额净值	1,016
94.期末基金份额净值	1,016
95.期末基金份额净值	1,016
96.期末基金份额净值	1,016
97.期末基金份额净值	1,016
98.期末基金份额净值	1,016
99.期末基金份额净值	1,016
100.期末基金份额净值	1,016

注：截止日期为2015年6月30日。

本基金于2012年6月7日成立，建仓期6个月，即从2012年6月7日起至2012年11月6日，建仓期结束时各项

§2 报告期末按行业分类的股票投资组合	
序号	行业类别
A	农林、牧、渔业
B	采矿业
C	制造业
D	电力、热力、燃气及生产和服务供应业
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
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	教育、体育和娱乐业
P	教育
Q	卫生和社工作
R	文化、体育和娱乐业
S	综合
合计	2,293,620,669.53

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	300287	风信信	7,800,000	297,024,000.00	10.47
2	002075	广信股份	3,080,002	170,988,551.00	6.03
3	000991	航天科技	2,554,912	167,985,464.00	5.92
4	600833	第一医药	6,599,457	15,787,511.00	5.38
5	600125	铁牛物流	9,366,260	144,521,391.00	5.09
6	600511	国药股份	2,322,800	117,045,892.00	4.13
7	300155	安居客	2,755,551	110,607,817.14	3.90
8	601006	大秦铁路	7,774,801	109,158,206.04	3.85
9	600479	天富能源	5,094,290	107,048,055.10	3.81
10	002082	北京股份	3,142,720	93,338,784.00	3.29

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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、处罚的情况。

5.11.2 申明本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。

5.11.3 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11.4 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

5.11.6 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贵金属投资明细

5.11.7 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权证投资明细

5.11.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.10 投资组合报告附注

5.11.11 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、处罚的情况。

5.11.12 申明本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。

5.11.13 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11.14 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.15 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

5.11.16 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

5.11.17 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

5.11.18 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11.19 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.20 投资组合报告附注

5.11.21 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、处罚的情况。

5.11.22 申明本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。

5.11.23 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11.24 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.25 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

5.11.26 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

5.11.27 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

5.11.28 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11.29 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.30 投资组合报告附注

5.11.31 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、处罚的情况。

5.11.32 申明本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。

5.11.33 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11.34 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.35 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

5.11.36 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

5.11.37 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

5.11.38 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11.39 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.40 投资组合报告附注

5.11.41 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、处罚的情况。

5.11.42 申明本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。

5.11.43 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11.44 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.45 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

5.11.46 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

5.11.47 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

5.11.48 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11.49 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.50 投资组合报告附注

5.11.51 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、处罚的情况。

5.11.52 申明本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。

5.11.53 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11.54 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.55 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

5.11.56 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

5.11.57 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

5.11.58 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11.59 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.60 投资组合报告附注

5.11.61 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、处罚的情况。

5.11.62 申明本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。

5.11.63 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.11.64 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.65 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

5.11.66 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

5.11.67 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

5.11.68 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明