

上证综指交易型开放式指数证券投资基金

[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：中国工商银行股份有限公司
报告书出具日期：2015年07月21日

1

重要提示

注：表中的股息派息的金额包含可转待款估值增值，而5.3的合计项不含可转待款估值增值。

5.2 报告期末未持有股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票投资股票。

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 709,160.00 0.22

B 制造业 40,454,718.65 12.50

C 制造业 91,133,19.35 28.16

D 电子、通信、计算机、水利、环境和公用事业 15,275,04.38 4.72

E 建筑业 16,353,790.64 5.05

F 批发和零售业 10,971,300.74 3.39

G 交通运输、仓储和邮政业 19,017,149.98 5.90

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 7,313,559.66 2.26

J 金融、证券业 85,382,502.77 26.52

K 房地产业 11,254,455.88 3.48

L 租赁和商务服务业 1,202,855.00 0.37

M 科学研究、技术服务和地质勘查业 - -

N 水、环境和公共设施管理业 1,321,990.62 0.41

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 4,747,884.88 1.47

S 综合 819,680.00 0.25

合计 306,522,225.85 94.70

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.4.1 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股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601875 中国石油 1,587,458 5.56

2 601288 农业银行 3,007,239 3.45

3 601998 中国银行 2,073,600 3.13

4 601626 中国人寿 208,543 0.20

5 600028 中国石化 999,688 1.98

6 600000 浦发银行 275,640 1.44

7 600002 招商银行 223,522 1.29

8 600682 南京银行 109,500 1.27

9 601166 兴业银行 235,370 1.26

10 601328 交通银行 488,920 1.24

5.4.2 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

注：本基金本报告期末未持有债券投资股票。

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 - -

2 央行票据 - -

3 金融债 - -

4 企业债 - -

5 企业短期融资券 - -

6 中期票据 - -

7 可转债 65,389.50 0.02

8 其他 - -

9 合计 65,389.50 0.02

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五名债券投资明细

序号 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 110032 中国银行 450 65,389.50 0.02

5.7 我们的朋友在公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名货币市场基金

注：本基金本报告期末未持有货币市场基金。

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货币市场基金

注：本基金本报告期末未持有货币市场基金。

5.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.10 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衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有衍生品。

5.11 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股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.12 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组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.13 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组合

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.14 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前五只基金

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前五只基金。

5.15 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名证券

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名证券。

5.16 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券。

5.17 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证。

5.18 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品。

5.19 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票。

5.20 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券。

5.21 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证。

5.22 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品。

5.23 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票。

5.24 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券。

5.25 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证。

5.26 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品。

5.27 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票。

5.28 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券。

5.29 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证。

5.30 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品。

5.31 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票。

5.32 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券。

5.33 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证。

5.34 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品。

5.35 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票。

5.36 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券。

5.37 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证。

5.38 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品。

5.39 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票。

5.40 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券。

5.41 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证。

5.42 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品。

5.43 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票。

5.44 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券。

5.45 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证。

5.46 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品。

5.47 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票。

5.48 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名债券。

5.49 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名权证。

5.50 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名衍生品。

5.51 报告期内按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票

注：本基金本报告期无按公允价值占基金资产净值比例变动幅度最大的前十名股票。

5.52 报告