

信息披露 Disclosure

富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金

015 半年度报告摘要

43	600096	宁夏新宁	14,168,052.09	2.31
44	613031	国盛国际	14,111,138.97	2.31
45	022405	中国国旅	13,105,223.00	2.15
46	002288	富临电力	14,084,656.26	2.30
47	600764	银星股份	14,064,477.47	2.30
48	003152	元森股份	13,585,762.78	2.29
49	000653	盛运环保	13,362,136.71	2.17
50	600764	银星股份	13,177,281.40	2.15
51	300297	博彦科技	13,168,340.00	2.15
52	000667	顺鑫农业	14,040,776.82	2.31
53	002373	午子科技	12,065,362.26	2.11
54	000662	广东药服	12,621,581.54	2.11

5. 期末应付账款按欠款人类型分类的账龄分析表如下表所示, 不考虑相关交易费用。

账龄	期末应付账款余额	按欠款人类型分类的应付账款余额占期末应付账款总额的比例
1 年以内	1,000,000.00	20.00%
1 年以上	4,000,000.00	80.00%
合计	5,000,000.00	100.00%

序号	股票代码	股票名称	金额单位:元	
			本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例
1	002024	苏宁云商	107,016,533.06	17.49
2	003118	中国平安	81,829,803.36	13.38
3	002142	宁波银行	80,162,346.46	13.10
4	001933	永辉超市	67,774,869.10	11.08
5	000712	南京股份	67,419,600.98	11.02
6	000670	恒生电子	57,108,628.19	9.23
7	000001	平安银行	53,095,108.22	8.68
8	002560	红墙股份	50,793,577.27	8.30
9	000000	浦发银行	49,855,914.07	7.94
10	000144	天津港	44,110,394.51	7.22
11	000111	北方稀土	41,466,880.51	6.70
12	002061	阳明医疗	39,762,768.76	6.56
13	002406	国脉高新	38,913,299.00	6.36
14	000015	华夏银行	36,294,637.26	5.93
15	001106	兴业银行	34,223,162.70	5.63
16	002410	广联达	33,973,747.50	5.55
17	002216	浙商银行	32,321,292.94	5.33
18	000063	华东医药	32,026,631.89	5.48
19	000037	赛轮轮胎	32,017,115.24	5.29
20	300058	蓝色光标	29,423,224.06	4.91
21	001001	中国太保	29,281,470.38	4.79
22	002230	科大讯飞	27,417,790.00	4.32
23	000887	通化东宝	26,583,674.26	4.28
24	002004	洋河股份	26,583,428.72	4.28
25	000887	云铝股份	26,276,170.20	4.13
26	000087	世纪铝业	26,266,789.30	4.13
27	300341	聚尔声学	24,895,383.10	4.06
28	000276	恒顺醋业	24,749,888.38	4.06
29	000086	天津银行	23,676,627.26	3.90
30	000858	广汇能源	23,516,294.46	3.89
31	001009	南京银行	22,679,491.22	3.71
32	300244	康达新材	22,575,813.14	3.69

33	002218	久立特材	22,367,206.42	3.66
34	002293	罗莱家纺	20,616,220.91	3.67
35	002182	云海金属	20,431,528.79	3.34
36	002263	众瑞股份	20,429,860.54	3.34
37	002226	国联新材料	20,395,546.99	3.33
38	002695	恒裕集团	19,544,359.94	3.33
39	002228	新凤鸣	19,947,054.16	3.28
40	000976	赣民集团	19,677,300.92	3.22
41	000003	盛达矿业	19,570,530.63	3.20
42	600007	中国国贸	19,336,428.51	3.16
43	000680	卧龙电气	19,229,092.13	3.14
44	000387	南泰控股	18,926,318.54	3.09
45	000138	中南铝	18,686,476.65	3.05
46	002466	天齐锂业	17,947,423.91	2.93
47	000446	金证股份	17,825,510.98	2.91
48	002031	奥瑞德	17,625,367.18	2.90
49	000678	中盘股份	17,710,240.62	2.89
50	000029	千金药业	17,576,974.98	2.87
51	300037	新宙邦	17,161,103.21	2.80
52	300204	舒泰神	17,136,380.77	2.80
53	300250	新天科技	16,298,272.00	2.66
54	300049	耀隆股份	16,212,441.35	2.66
55	000012	顺风祥	16,162,199.89	2.66
56	002239	精成电子	16,019,193.13	2.62
57	002273	千方科技	15,552,097.89	2.54
58	000783	华鲁恒升	15,067,000.49	2.51
59	002201	齐心集团	15,353,828.03	2.51
60	000199	金种子酒	14,291,040.09	2.34
61	002117	东睦股份	14,161,473.44	2.31
62	300207	润达士	14,127,887.06	2.31
63	600649	三友化工	13,746,264.00	2.25
64	001096	晋申动力	13,304,200.74	2.17
65	300156	锦源环保	12,960,146.40	2.12

[illegible]

序号	名称	金额
1	存在保证金	574,795.04
2	应收证券清算款	20,324,000.72
3	应收股利	-
4	应收利息	9,273.32
5	应收申购款	987,960.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,906,049.96

2.4 期末持有的处于转股期的可转换债券余额

2.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

2.6 报告期末货币资金余额

序号	股票代码	股票名称	流通受限股份占非公开发行股份比例	占基金净资产公允价值比例	流通受限情况说明
1	002223	鱼跃医疗	43,689,000.00	9.31	第32号重大事项
2	601012	春秋航空	26,216,729.03	5.57	第32号重大事项
3	300145	宋城演艺	19,216,129.00	3.88	第32号重大事项
注：根据中国证监会《上市公司重大资产重组管理办法》第十四条、第四十四条的适用意见，非公开发行购买资产不构成重大资产重组。					
期末基金五户因，投资组合中报告期末公允价值比例的分项之和与合计可能存在误差。					
附期末基金份额持有人户数及基金份额持有情况统计					
			份额单位：份		
持有基金份额户（户）	户均持有的基金份额	机构投资者	持有人数		
			持有份额	占份额比例（%）	个人投资者
12464	21,529,014	98,029,263.96	36.56	170.47	401,182
					63.45

期末基金管理人持有的从业人员持有本开放式基金的情况			单位:份
基金管理人持有本基金	持有的基金份额(份)	占基金总份额比例(%)	
基金管理人所有从业人员持有本基金	349,048,040	0.1304	
期末基金管理人持有的从业人员持有本开放式基金基金份额数量区间的情况			
项目	持有的基金份额数量区间(万份)		
公司高级管理人员及基金经理持有本开放式基金	10-50		
其他人员持有本开放式基金	10-50		
本基金基金经理持有本开放式基金	0-5		
本报告期内基金从业人员变动情况			
基金合同生效以来的10月(前10月12日)基金份额总额			1,436,157,094.62
报告期末基金份额总额			1,520,281,358.04
本报告新增基金份额申购份额			1,290,022,906.04
减:本报告基金份额赎回份额			1,643,129,119.76

本期新增基金份额变动的影响		
本期应扣回未兑付基金申购费		269,175,738.07
§ 10 重大事件揭示		
1. 基金持有人持有人大会决议		
报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。		
2. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动		
报告期内本基金管理人、基金托管人、基金销售机构均没有发生重大人事变动。		
3. 基金经理变更		
报告期内,本基金基金经理于2016年10月10日发布公告,李爱英女士、姜永辉先生自2016年10月10日起担任本基金基金经理人。		
基金管理人已于2016年11月31日发布公告,聘任姜永辉先生自2016年11月30日起担任本基金董事。		
4. 基金及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼		
报告期内没有发生基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。		
5. 基金投资策略的改变		
报告期内基金投资策略没有改变。		
6. 基金管理人聘任的会计师事务所情况		
报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。		
7. 对基金份额持有人权益及基金资产净值产生重大影响的事项		
报告期内,本基金及基金管理人没有发生对基金份额持有人权益及基金资产净值产生重大影响的事项。		

本期基金租用证券公司交易单元的有关情况							金额单位：人民币元
券商名称	交易单元数量	股票交易	债券交易	债券回购交易	权证交易	应支付券商的佣金	备注
		占当期股票成交金额的比例 (%)	占当期债券成交金额的比例 (%)	占当期债券回购成交金额的比例 (%)	占当期权证成交金额的比例 (%)	佣金	
		成交金额	成交金额	成交金额	成交金额		

地区	年份	653,341	178	0	0.00	10,000,000	23.1	0	0.00	665,460,463	17.6
东源县	2017	67,794	9	0	0.00	0	0.00	0.00	0.00	68,186,163	1.04
广宁县	2017	888,323	26.1	6	1.201,354.50	32,200,000	76.8	5	0.00	776,005,000	26.1
云浮市	2017	509,000	0.04	0	0.00	0	0.00	0	0.00	1,220,074	0.04
阳江市	2017	14,449	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	13,759,044	0.42
珠海市	2017	476,763	13.4	4	0.00	0	0.00	0	0.00	422,728.66	13.2
江门市	2017	218,217	6.10	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00
肇庆市	2017	218,217	6.10	0	0.00	0	0.00	0	0.00	195,550,662	6.10

华安证券	1	288,344,728.00	74.8	—	0.00	—	0.00	—	0.00	244,303,603	7.71
民生证券	2	166,073,194.94	4.3	—	0.00	—	0.00	—	0.00	140,753,139	4.45
申万宏源	3	224,430,177.02	6.34	—	0.00	—	0.00	—	0.00	204,323,652	6.46
湘财证券	1	—	—	—	0.00	—	0.00	—	0.00	—	—
兴业证券	1	36,026,101.28	1.02	—	0.00	—	0.00	—	0.00	—	—
银河证券	1	377,137,153.63	10.6	—	0.00	—	0.00	—	0.00	32,750,001	1.04
招商证券	2	124,170,251.06	3.61	—	0.00	—	0.00	—	0.00	130,138,657	3.86
中投证券	1	—	—	—	0.00	—	0.00	—	0.00	—	—

中信证券	1	54,130,220.86	153	-	0.00	-	0.00	-	0.00	49,280.15	156	
------	---	---------------	-----	---	------	---	------	---	------	-----------	-----	--

1. 我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金退租券商交易单元：红塔证券25547。其余租用券商交易单元未发生变动。

关联方名称	本期(2015年10月1日至2015年10月30日)			
	佣金	占当期佣金总额的 比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总 额的比例(%)
申万宏源	204,329.52	6.46	102,743.36	4.51
海通证券	422,728.66	13.26	308,096.00	13.66
关联方名称	上年度可比期间(2014年10月1日至2014年10月30日)			
	佣金	占当期佣金总额的 比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总 额的比例(%)
海通证券	64,911.01	10.54	16,797.13	14.89
申银万国	677,032.02	93.41	97,032.02	85.10

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，公司支付给券商的佣金按扣税后净额列示；2、上述应付佣金为期末应付未付款项，截至报告期末前仍未支付的原因主要是：基金管理人因未在关联方披露的其他服务中主要包括：为基金提供的研究支持和服务(如研究报告、研究报告、研究报告等)。

2、关联方为宁波甬兴证券有限公司(简称“宁波甬兴”)，是由原东方证券股份有限公司和东方资产管理股份有限公司于2015年7月16日合并组建而成。上表所示的关联方为发行及承销过程中与发行人存在关联关系的关联方，如交易行为未通过关联方申报发行证券所提交的总信息。

6.4.8.2 基金管理人
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]
当期发生的基础设施投资的管理费	6,428,119.06	1,314,341.84
其中：支付基础设施项目的维护费	2,160,431.44	343,211.01
H-1至H-150%当日净资产	-	-
H-1至H-150%当日净资产	-	-
150%当日净资产	-	-
150%当日净资产	-	-
基金管理人每日计提，按日累计至每月月末，按月支付。	-	-
6.4.8.2 基金托管人	-	-

单位：人民币元	项目	本期(2015年10月1日至2015年10月31日)	上年度可比期间(2014年10月1日至2014年10月31日)
当期发生与基金有关的应付利息		1,071,363.87	219,063.56
当期发生与基金有关的应付利息是指当期基金资产净值(期末资产净值)的0.25%的年费。计算方法如下： $H = E \times 0.25\% \times \text{天数}$ H为应付利息，E为基金资产净值，天数为基金资产净值在应付利息计提期间的天数。 2015年10月的基金资产净值 基金托管人按日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。 6.4.3.2 天数的计算为进行前月月末至前月月末。 基金管理人本报告期末上年度可比期间以及与关联方发生前月月末至前月月末市场进行债券(含)回购交易。 6.4.3.3 基金本报告期末上年度可比期间以及与关联方发生前月月末至前月月末市场进行债券(含)回购交易。 6.4.3.4 本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况			
单位：人民币元	项目	本期(2015年10月1日至2015年10月31日)	上年度可比期间(2014年10月1日至2014年10月31日)
基金合同生效日至2015年10月31日			

[illegible]

关联方名称	关联关系	当期期初至报告期末	当期期初至报告期末	当期期初至报告期末	当期期初至报告期末
		占净资产比例	占净资产比例	占净资产比例	占净资产比例
中国工商银行股份有限公司	贷款	62,200,470.24	227,267.70	1,009,332.44	5,112.92
本公司在报告期内与关联方发生关联交易情况如下： 注：本报告期间及上年度可比期间内本公司均未在报告期内直接购入关联方承销证券。 6.4.7 其他关联交易情况的说明 本公司报告期内及上年度可比期间内未发生其他关联交易事项。 6.4.9 附注（2015年06月30日）本公司持有的流通受限证券 6.4.9.1 按公允价值计量的流通受限证券 6.4.9.1.1 按公允价值计量的流通受限证券 6.4.9.1.2 按公允价值计量的流通受限证券					
证券代码	证券名称	成交日期	成交金额	期末公允价值	期末公允价值
			交易类型	（单位：元）	期末公允价值
2015.06.1	2015-06-06	2015-07-07	10.4	10.4	10.4

64.5.2 金銀幣單位:人民幣元		單位:百萬元		單位:百萬元		單位:百萬元		單位:百萬元		單位:百萬元	
股票代碼	股票名稱	停牌日期	停牌原因	期末交易價格 (元)	復牌日期 (2019年7月6日)	復牌日期 (2019年7月6日)	復牌日期 (2019年7月6日)	數目 (股數)	期末 成本(百股)	期末 市價(百股)	備註
000962	廣藥集團	2019-06-26	筹划重大事項	16.30	2019-7-6	2019-7-6	14.18	600,000	12,632,581.54	9,180,000.00	
002223	德展集團	2019-06-26	筹划重大事項	67.20	2019-7-15	2019-7-15	60.48	656,000	15,772,306.79	43,680,000.00	
002446	中國精工	2019-06-02	筹划重大事項	61.39	-	-	-	299,930	14,104,239.66	15,413,402.70	

300416	荣成转债	2015-06-15	荣成双债大面	66.60	$\frac{6-0}{1-0}$	68.02	321.90	23.11, 370.78	18.216, 190.900
600060	宁波舜升	2015-06-22	荣成双债大面	30.70	$\frac{8-1}{1-1}$	21.58	449.50	14.158, 932.89	13.912, 114.28
601021	春秋航空	2015-06-26	荣成双债大面	128.01	$\frac{7-2}{1-2}$	113.4	109.90	21.668, 702.10	25.216, 739.10

6.4.3.3 本期转债首次回售公告中约定的回售利率为4.31% 银行间市场债券正回购
注：截至本表报告期末2016年6月30日止，本基金已从从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回

6.4.3.2 短期市场债券正回购
注：截至本表报告期末2016年6月30日止，本基金已从从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回

6.4.10 交易对手信用风险公允价值变动损益及公允价值变动损益

6.14.1.4 公允价值

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

公允价值计量的输入值分为三个层次，即：第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

公允价值计量输入值的可观察性越强，其公允价值计量所属层次越低。

6.14.1.5 公允价值计量的工具

公允价值计量的工具是指公允价值计量过程中使用的估值技术，包括市场法、成本法和收益法等。

6.14.1.6 公允价值计量的披露

公允价值计量的披露是指基金管理人应当在基金年度报告中披露公允价值计量的相关信息，包括公允价值计量的工具、公允价值计量的输入值、公允价值计量的输出值等。

6.14.1.7 公允价值计量的其他规定

基金管理人应当在基金年度报告中披露公允价值计量的其他相关信息，包括公允价值计量的内部控制制度、公允价值计量的风险管理措施等。

6.14.1.8 公允价值计量的其他规定

基金管理人应当在基金年度报告中披露公允价值计量的其他相关信息，包括公允价值计量的内部控制制度、公允价值计量的风险管理措施等。

6.14.1.9 公允价值计量的其他规定

基金管理人应当在基金年度报告中披露公允价值计量的其他相关信息，包括公允价值计量的内部控制制度、公允价值计量的风险管理措施等。

6.14.1.10 公允价值计量的其他规定

基金管理人应当在基金年度报告中披露公允价值计量的其他相关信息，包括公允价值计量的内部控制制度、公允价值计量的风险管理措施等。

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。			
7.1 期末基金资产组合情况		投资组合报告	
序号	项目	金额	金额占总资产的比例 %
1	权益投资	430,237,022.95	
	其中:股票	430,237,022.95	
2	固定收益投资	--	
	其中:债券	--	
	资产支持证券	--	
3	贵金属投资	--	
4	金融衍生品投资	--	
5	买入返售金融资产	--	
基金资产合计		430,237,022.95	100.00

6	银行存款和贴资金票合计	47,799,164.14	
7	其他流动资产	21,000,048.90	
8	合计	567,943,133.66	1

2、期末按行业分类的长期股权投资组合余额按行业分类汇总

代码	行业类别	公允价值（元）	占期末资产净值比例（%）
A	农林、牧、渔业	9,600,000.00	
B	采矿业	—	
C	制造业	284,462,156.06	
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	
E	建筑业	—	
F	批发和零售业	—	
G	交通运输、仓储和邮政业	26,216,729.10	

H	住宿和餐饮业	11,918,837.89
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-
J	金融业	70,779,000.01
K	房地产业	-
L	租赁和商务服务业	18,066,000.00
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	居民服务、修理和其他服务业	-
P	教育	-
Q	卫生和社公工作	-
R	文化、体育和娱乐业	18,216,190.00
S	综合	-

代码	股票简称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 %
001022	华安证券	600,000	49,680,000.00	
601166	兴业银行	2,300,000	39,676,000.00	
300626	国联新材	723,800	26,183,600.00	
601051	春秋航空	109,000	26,216,738.10	
002116	华普信	300,000	24,425,000.00	
002266	齐鑫股份	100,000	22,134,000.00	
300144	宋城演艺	321,500	18,216,100.00	
300178	腾药国际	500,000	18,056,000.00	
300681	永贵电器	470,000	18,024,500.00	

注：报告期内，本所管理的基金资产投资于有价证券，应属境内、外股票基金资产。

注：报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%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	603131	中国重汽	72,399,208.34	
2	002422	宝通软件	68,354,816.42	
3	603166	瑞丰银行	39,071,064.92	
4	601010	宝钢股份	31,611,317.06	
5	600003	浦发银行	44,256,816.42	
6	600000	浦发银行	36,982,848.87	
7	002621	华康药业	39,311,283.85	
8	600311	北方稀土	38,734,888.04	
9	603117	长华股份	35,811,283.85	
10	600013	浦发银行	35,679,430.67	

11	00232	洋灰粉	25.628	85.249
12	00306	煤油	38.484	122.024
13	69095	華里洋灰	27.739	326.40
14	67103	生油	27.751	400.70
15	30454	生油	26.481	255.45
16	69082	通化生油	27.061	314.972
17	30378	麵粉	25.704	705.70
18	30307	蘇打粉	23.186	667.70
19	00241	熟油	25.820	790
20	30344	木炭	23.110	27.038
21	30294	舒神糖	23.046	163.89
22	00286	白糖	23.046	163.89
23	30301	水銀	22.170	188.64
24	67103	生油	21.036	166.66
25	00276	白糖	21.036	166.66
26	00058	五號糖	20.890	174.06
27	00239	紅糖	21.846	174.06

28	000262	先施股份	17,884,746.54
29	300259	赢时科技	17,387,146.98
30	001009	中信特钢	17,431,335.33
31	600687	南方航空	16,674,393.48
32	600138	中航油	16,174,327.53
33	001698	海信视像	15,251,452.30
34	600612	老恒春	14,704,893.10
35	000072	云南铜业	15,626,324.35
36	601100	北方稀土	15,626,324.35
37	002239	德化陶瓷	14,904,491.25
38	000691	四川九洲	14,662,412.60
39	000650	金飞豹	14,575,778.64
40	600651	飞马国际	14,456,263.16
41	600056	华力宝	14,384,580.60
42	002477	鼎泰新材	13,354,242.00

[illegible]

基金募集情况		§ 2 基金简介
基金名称	富国国际债增衡主题股票	
基金代码	100039	
副代码	前募集代码: 100039 后募集代码: 000035	
基金运作方式	契约开放式	
基金合同生效日	2010年06月12日	
基金管理人	富国基金管理有限公司	
基金管理人	中国工商银行股份有限公司	
截至报告期末基金资产的净值总额	265,175,738.77元	
基金合同存续期	不定期	

基金管理人及基金托管人承诺：自2015年7月21日起，将“普通短期融资券和超短期融资券”更名为“短期融资券”并纳入基金投资组合，基金管理人承诺在基金合同中明确基金管理人运用基金资产投资于短期融资券的投资范围、投资策略、投资比例、投资限制、估值方法、信息披露、风险控制等，并将基金管理人投资短期融资券是否属于混合型基金投资特征，并相应修改基金的风险收益特征。 基金名称(简称)			
基金名称	本基金除投资于中国证监会认可的境外投资标的，通过投资境外投资标的资产，力求获得超越境内资产投资不能达到的超额收益，追求投资境外投资标的的绝对增值，从而为投资者创造长期稳定的增值收益。 本基金投资于“自偿性”资产(如银行承兑汇票和“自偿性”)资产等低风险收益资产在总资产中的配置比例不低于80%，且投资于境外资产的比例不高于20%。 沪深300指数收益率×80%+中国国债收益率×20% 本基金是一以主动投资型的基金，属于较高风险收益基金，预期收益由基金资产净值波动产生，并长期固定收益资产和固定收益资产、股票资产与固定收益资产。		
基金管理人	招商基金管理人	基金管理人	基金管理人
	招商基金管理人有限公司	招商基金管理人有限公司	招商基金管理人有限公司

信息联络负责人	姓名	范伟伟	谢松云
	联系电话	021-20306118	010-66106799
	电子邮箱	vanweiwei@tutol.com.cn	chenyao@tutol.com.cn
售后服务电话		66106799	
	传真	021-20306116	010-66106798
信息披露方式			
最近两年年度报告正文的刊登地	www.tutol.com.cn		
最近半年度报告备置地点	福建松云管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道177号海地中心二期16-17层中国石化国际技术服务中心 北京经济技术开发区海地中心二期16-17层		
主要财务指标、基本财务表现			
主要会计数据和财务指标	3.3		金额单位：人民币
	3.3.1 回顾数据和指标		报告期间数据/指标
			2011年1月1日至2011年6月30日

[illegible]

阶段	前月 环比	前季 环比	前半年 环比	前一年 环比	①-③	②-④
去一月	-14.26%	3.82%	-5.88%	29.0%	-8.38%	0.62%
去二月	9.7%	2.01%	-	-	-0.62%	-
去三月	23.0%	2.0%	22.10%	18.1%	0.27%	0.28%
去年一	93.01%	1.74%	82.54%	1.47%	10.47%	0.27%
去年二	101.26%	1.37%	67.69%	1.27%	23.66%	0.17%
基金合同生效日	82.00%	1.26%	54.90%	1.19%	37.90%	0.19%

本基金业绩比较基准为： $\text{沪深300指数收益率} \times 80\% + \text{中证综合债指数收益率} \times 20\%$ 。

本基金对投资于股票类资产和债券类的有关规定：本基金业绩比较基准为： $\text{沪深300指数收益率} \times 80\% + \text{中证综合债指数收益率} \times 20\%$ 。

本基金类别资产配置比例、固定收益类资产投资比例的业绩比较基准分别采用有代表性的沪深300指数和中证综合债指数。

本基金交易对手选择标准及授信流程进行内部控制，执行利率（benchmark）跟踪下有公式计算：

1. 1, 2, 3, ..., T, T+1 中间数据空白;
 2. 日收益函数 (benchmark) 按下列公式计算:

$$\text{benchmark}(t) = \text{PI}(t) \times (1 + \text{benchmark_rate}) - 1$$

 3. T, 2, 3, 4, ..., T, T+1, benchmark_T 表示自 t 日至 T 日的 1+benchmark_T 数字连乘。
 基金合同生效以来, 某基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准和收益率变动的比较

净值增长率与业绩比较基准走势一年度比较图

截止日期为2015年04月30日

本基金于2010年04月12日成立,建仓期自2010年05月12日至2010年11月11日共六个月,建仓期结束时各项资产均符合合同约定。

4 管理人报告

基金管理人及基金经理

基金管理人及其基金经理的经验

基金管理人自1990年4月13日获国家工商行政管理局登记注册成立,并经中国证监会批准设立

[illegible][illegible][illegible][illegible][illegible][illegible][illegible]

在托管期间基金份额持有人利益的行为,在托管期间托管人按照基金托管协议及基金合同的有关规定执行。本报告期内,本基金托管人履行了职责,遵守了基金合同中关于托管业务的有关规定,未发现有任何事项损害基金份额持有人的利益,本基金托管人进行了有效的监督,并定期出具托管报告,分配金额人民币10,180,536.00元。

托管人对本半年度投资运作中涉及费用的支出、准确和完整发表意见。

托管人对基金管理人富国基金管理有限公司编制和披露的富国通惠主题轮动股票型证券投资报告2015年半年度财务数据、持仓结构、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

二、工商登记资产托管部

截至2015年06月30日

资产估值表

资产名称:富国通惠主题轮动股票型证券投资基金

截止日:2015年06月30日

单位:人民币