

富国中证煤炭指数分级证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人：富国基金管理有限公司
基金托管人：国泰君安证券股份有限公司
报告送出日期：2016年01月20日

1.1 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。
基金管理人富国基金管理有限公司根据本基金合同约定，于2016年1月18日发布了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证所载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以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金不受损失。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。
本财务报表审计机构：普华永道会计师事务所
本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

基金简称	富国中证煤炭指数分级
基金代码	161022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年09月19日
报告期末基金总份额	279,534,326.50
基金业绩比较基准	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证煤炭指数，在正常市场情况下，力争将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，长期跟踪偏离度控制在4%以内。
投资目标	本基金主要采用完全复制法进行投资，依托指数化投资平台，利用长期稳定的风险模型和交易成本模型，跟踪中证煤炭指数在沪深两市中的表现及其基金合同约定的投资组合，以实现对中证煤炭指数的有效跟踪，并控制跟踪误差及投资组合的波动率。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，依托指数化投资平台，利用长期稳定的风险模型和交易成本模型，跟踪中证煤炭指数在沪深两市中的表现及其基金合同约定的投资组合，以实现对中证煤炭指数的有效跟踪，并控制跟踪误差及投资组合的波动率。
业绩比较基准	95%×中证煤炭指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、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	国泰君安证券股份有限公司
下属分级基金的基金简称	煤炭A
下属分级基金的基金代码	161022
报告期末下属分级基金的份额总额	150,021,717.50
报告期末下属分级基金的资产净值	104,756,304.00
报告期末下属分级基金的风险收益特征	富国煤炭A的份额具有低风险、预期收益相对稳定的特征。

3.1 主要财务指标	3.2 主要财务指标和基金净值表现
1.本期已实现收益	-22,460,727.41
2.本期利润	-41,082,880.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.1434
4.期末基金资产净值	304,710,920.76
5.期末基金份额净值	1.00

3.3 基金业绩比较基准	3.4 基金管理人
1.本基金业绩比较基准	95%×中证煤炭指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
2.本基金业绩比较基准	95%×中证煤炭指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
3.本基金业绩比较基准	95%×中证煤炭指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
4.本基金业绩比较基准	95%×中证煤炭指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
5.本基金业绩比较基准	95%×中证煤炭指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）

3.5 基金管理人	3.6 基金管理人
1.基金管理人	富国基金管理有限公司
2.基金管理人	富国基金管理有限公司
3.基金管理人	富国基金管理有限公司
4.基金管理人	富国基金管理有限公司
5.基金管理人	富国基金管理有限公司

3.7 基金管理人	3.8 基金管理人
1.基金管理人	富国基金管理有限公司
2.基金管理人	富国基金管理有限公司
3.基金管理人	富国基金管理有限公司
4.基金管理人	富国基金管理有限公司
5.基金管理人	富国基金管理有限公司

3.9 基金管理人	3.10 基金管理人
1.基金管理人	富国基金管理有限公司
2.基金管理人	富国基金管理有限公司
3.基金管理人	富国基金管理有限公司
4.基金管理人	富国基金管理有限公司
5.基金管理人	富国基金管理有限公司

3.11 基金管理人	3.12 基金管理人
1.基金管理人	富国基金管理有限公司
2.基金管理人	富国基金管理有限公司
3.基金管理人	富国基金管理有限公司
4.基金管理人	富国基金管理有限公司
5.基金管理人	富国基金管理有限公司

3.13 基金管理人	3.14 基金管理人
1.基金管理人	富国基金管理有限公司
2.基金管理人	富国基金管理有限公司
3.基金管理人	富国基金管理有限公司
4.基金管理人	富国基金管理有限公司
5.基金管理人	富国基金管理有限公司

3.15 基金管理人	3.16 基金管理人
1.基金管理人	富国基金管理有限公司
2.基金管理人	富国基金管理有限公司
3.基金管理人	富国基金管理有限公司
4.基金管理人	富国基金管理有限公司
5.基金管理人	富国基金管理有限公司

3.17 基金管理人	3.18 基金管理人
1.基金管理人	富国基金管理有限公司
2.基金管理人	富国基金管理有限公司
3.基金管理人	富国基金管理有限公司
4.基金管理人	富国基金管理有限公司
5.基金管理人	富国基金管理有限公司

3.19 基金管理人	3.20 基金管理人
1.基金管理人	富国基金管理有限公司
2.基金管理人	富国基金管理有限公司
3.基金管理人	富国基金管理有限公司
4.基金管理人	富国基金管理有限公司
5.基金管理人	富国基金管理有限公司

3.21 基金管理人	3.22 基金管理人
1.基金管理人	富国基金管理有限公司
2.基金管理人	富国基金管理有限公司
3.基金管理人	富国基金管理有限公司
4.基金管理人	富国基金管理有限公司
5.基金管理人	富国基金管理有限公司

3.23 基金管理人	3.24 基金管理人
1.基金管理人	富国基金管理有限公司
2.基金管理人	富国基金管理有限公司
3.基金管理人	富国基金管理有限公司
4.基金管理人	富国基金管理有限公司
5.基金管理人	富国基金管理有限公司

3.25 基金管理人	3.26 基金管理人
1.基金管理人	富国基金管理有限公司
2.基金管理人	富国基金管理有限公司
3.基金管理人	富国基金管理有限公司
4.基金管理人	富国基金管理有限公司
5.基金管理人	富国基金管理有限公司

3.27 基金管理人	3.28 基金管理人
1.基金管理人	富国基金管理有限公司
2.基金管理人	富国基金管理有限公司
3.基金管理人	富国基金管理有限公司
4.基金管理人	富国基金管理有限公司
5.基金管理人	富国基金管理有限公司

3.29 基金管理人	3.30 基金管理人
1.基金管理人	富国基金管理有限公司
2.基金管理人	富国基金管理有限公司
3.基金管理人	富国基金管理有限公司
4.基金管理人	富国基金管理有限公司
5.基金管理人	富国基金管理有限公司

富国中证煤炭指数分级证券投资基金

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	煤炭、焦炭、冶金	-	-
B	煤炭、焦炭、冶金	-	-
C	制造业	38,610.00	0.01
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	-	-
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	住宿、餐饮业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计	-	38,610.00	0.01

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	煤炭、焦炭、冶金	240,212,666.54	73.83
B	煤炭、焦炭、冶金	46,436,004.98	14.91
C	制造业	3,332,520	1.06
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	16,196,049.20	5.30
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	1,361,656,507.00	42.65
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	住宿、餐饮业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
合计	-	285,648,671.40	92.74

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	煤炭、焦炭、冶金	240,212,666.54	73.83
B	煤炭、焦炭、冶金	46,436,004.98	14.91
C	制造业	3,332,520	1.06
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	16,196,049.20	5.30
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	1,361,656,507.00	42.65
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	住宿、餐饮业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
合计	-	285,648,671.40	92.74

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	煤炭、焦炭、冶金	240,212,666.54	73.83
B	煤炭、焦炭、冶金	46,436,004.98	14.91
C	制造业	3,332,520	1.06
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	16,196,049.20	5.30
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	1,361,656,507.00	42.65
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	住宿、餐饮业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
合计	-	285,648,671.40	92.74

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	煤炭、焦炭、冶金	240,212,666.54	73.83
B	煤炭、焦炭、冶金	46,436,004.98	14.91
C	制造业	3,332,520	1.06
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	16,196,049.20	5.30
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	1,361,656,507.00	42.65
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	住宿、餐饮业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
合计	-	285,648,671.40	92.74

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	煤炭、焦炭、冶金	240,212,666.54	73.83
B	煤炭、焦炭、冶金	46,436,004.98	14.91
C	制造业	3,332,520	1.06
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	16,196,049.20	5.30
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	1,361,656,507.00	42.65
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	住宿、餐饮业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
合计	-	285,648,671.40	92.74

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	煤炭、焦炭、冶金	240,212,666.54	73.83
B	煤炭、焦炭、冶金	46,436,004.98	14.91
C	制造业	3,332,520	1.06
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	16,196,049.20	5.30
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	1,361,656,507.00	42.65
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	住宿、餐饮业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
合计	-	285,648,671.40	92.74

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	煤炭、焦炭、冶金	240,212,666.54	73.83
B	煤炭、焦炭、冶金	46,436,004.98	14.91
C	制造业	3,332,520	1.06
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	16,196,049.20	5.30
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	1,361,656,507.00	42.65
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	住宿、餐饮业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
合计	-	285,648,671.40	92.74

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	煤炭、焦炭、冶金	240,212,666.54	73.83
B	煤炭、焦炭、冶金	46,436,004.98	14.91
C	制造业	3,332,520	1.06
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	16,196,049.20	5.30
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	1,361,656,507.00	42.65
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	住宿、餐饮业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
合计	-	285,648,671.40	92.74

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	煤炭、焦炭、冶金	240,212,666.54	73.83
B	煤炭、焦炭、冶金	46,436,004.98	14.91
C	制造业	3,332,520	1.06
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	16,196,049.20	5.30
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	1,361,656,507.00	42.65
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	住宿、餐饮业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
合计	-	285,648,671.40	92.74

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	煤炭、焦炭、冶金	240,212,666.54	73.83
B	煤炭、焦炭、冶金	46,436,004.98	14.91
C	制造业	3,332,520	1.06
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	16,196,049.20	5.30
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	1,361,656,507.00	42.65
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	住宿、餐饮业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
合计	-	285,648,671.40	92.74

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	煤炭、焦炭、冶金	240,212,666.54	73.83
B	煤炭、焦炭、冶金	46,436,004.98	14.91
C	制造业	3,332,520	1.06
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	16,196,049.20	5.30
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	1,361,656,507.00	42.65
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	住宿、餐饮业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
R	综合	-	-
合计	-	285,648,671.40	92.74

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	煤炭、焦炭、冶金	240,212,666.54	73.83
B	煤炭、焦炭、冶金	46,436,004.98	14.91
C	制造业	3,332,520	1.06
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	16,196,049.20	5.30
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	房地产业	-	-
J	金融业	-	-
K	其他	-	-

17. 本基金投资于前十大公允价值占基金资产净值比例之和为 99.74%。本基金投资于前十大公允价值占基金资产净值比例之和为