富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金

二 0 一五年半年度报告

（摘要）

2015 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国农业银行股份有限公司

送出日期： 2015 年 08 月 27 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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。投资有风险，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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国天瑞强势混合
基金主代码	100022
交易代码	前端交易代码：100022 后端交易代码：100023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 04 月 05 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,678,853,133.90 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于强势地区（区域经济发展较快、已经形成一定产群规模且居民购买力较强）具有较强竞争力、经营管理稳健、诚信、业绩优良的上市公司的股票。本基金遵循“风险调整后收益最大化”原则，通过“自上而下”的积极投资策略，在合理运用金融工程技术的基础上，动态调整投资组合比例，注重基金资产安全，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要采用“自上而下”的主动投资管理策略，在充分研判宏观经济状况、资本市场运行特征的前提下，以强势地区内单个证券的投资价值评判为核心，追求投资组合流动性、赢利性、安全性的中长期有效结合。
业绩比较基准	上证 A 股指数收益率×70%＋上证国债指数收益率×25%＋同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，主要投资于强势地区中定价合理且具有成长潜力的优质股票，属于中度风险的证券投资基金品种。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产长期稳定增长，实现较高的超额收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	林葛
	联系电话	021-20361818	010-66060069
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95599
传真		021-20361616	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层 中国农业银行股份有限公司 北京复兴门内大街 2 8 号凯晨世贸中心东座 9 层

§3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 01 月 01 日至 2015 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	1,420,631,693.99
本期利润	1,308,111,967.85
加权平均基金份额本期利润	0.4693
本期基金份额净值增长率	49.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 06 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.8327
期末基金资产净值	2,112,122,125.70
期末基金份额净值	1.2581

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、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-11.92%	3.20%	-4.77%	2.35%	-7.15%	0.85%
过去三个月	17.79%	2.43%	10.43%	1.82%	7.36%	0.61%
过去六个月	49.46%	2.03%	23.20%	1.58%	26.26%	0.45%
过去一年	81.04%	1.60%	71.20%	1.26%	9.84%	0.34%

过去三年	81.74%	1.30%	65.06%	0.96%	16.68%	0.34%
自基金合同生效日起至今	727.91%	1.59%	191.08%	1.19%	536.83%	0.40%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准＝上证 A 股指数×70%＋上证国债指数×25%＋同业存款利率×5%。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用具有代表性的上证 A 股指数，债券投资部分的业绩比较基准采用具有代表性的上证国债指数。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1 日收益率（benchmarkt）按下列公式计算：

benchmarkt = 70% *[上证 A 股指数 t/(上证 A 股指数 t-1)-1] +25%* [上证国债指数 t/(上证国债指数 t-1)-1]+ 5% * 同业存款利率 / 360 ；

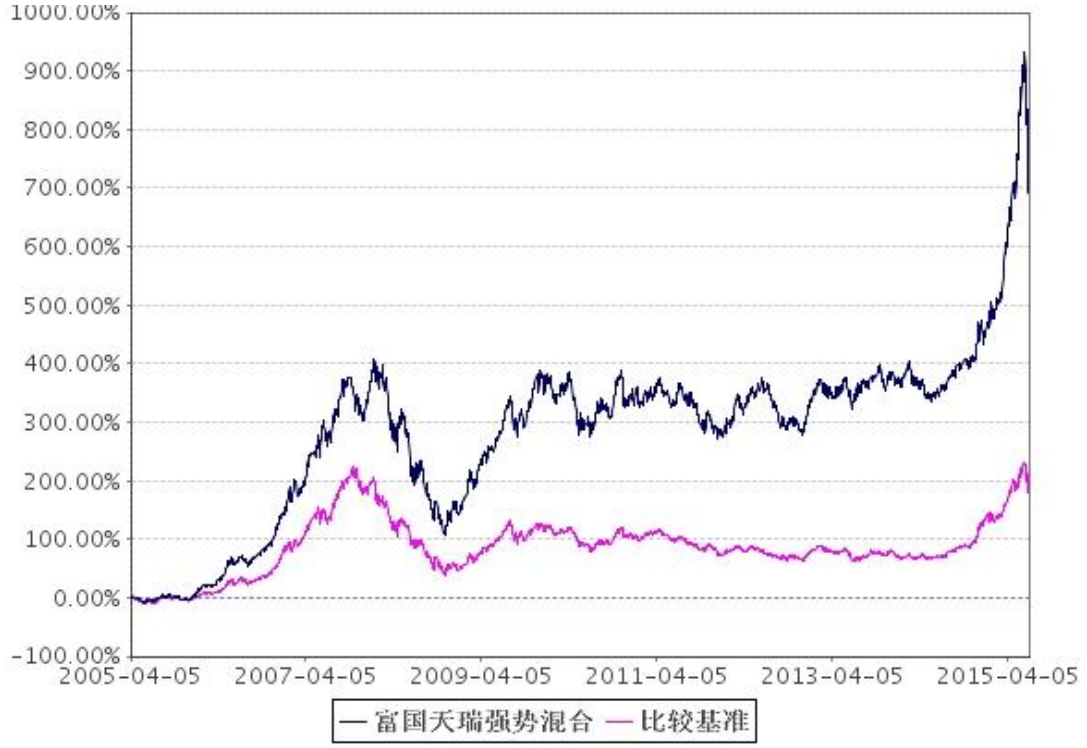
其中，t=1,2,3,…, T，T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmarkt)]-1

其中，T=2,3,4,…； ∏Tt=1(1+benchmarkt)表示 t 日至 T 日的(1+benchmarkt)数学连乘。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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。

2.本基金于 2005 年 4 月 5 日成立，建仓期 6 个月，从 2005 年 4 月 5 日至 2005 年 10 月 4 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。本基金于 2008 年 1 月 17 日拆分，规模急剧扩大，建仓期 3 个月，从 2008 年 1 月 22 日至 2008 年 4 月 21 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

富国基金管理有限公司已于 2008 年 01 月 17 日对投资者持有的富国天瑞强势地区混合型证券投资基金进行了基金份额拆分。经本基金托管人中国农业银行确认，拆分基准日（01 月 17 日），本基金的基金份额净值为人民币 2.3729 元，精

确到小数点后第 9 位（第 9 位以后舍去）为 2.372939797 元。本基金管理人按照 1:2.372939797 的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后，基金份额净值为人民币 1.0000 元，相应地，原来每 1 份基金份额变为 2.372939797 份，基金份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。本基金的基金总份额由拆分前的 1,011,783,054.90 份转换为拆分后的 2,400,900,277.08 份。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截至 2015 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国消费主题混合型证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天博创新主题股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金、富国汇利回报分级债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业股票型证券投资基金、富国中国中小盘(香港上市)股票型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国信用增强债券型证券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国医疗保健行业股票型证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国恒利分级债券型证券投资基金、富国城镇发展股票型证券投资基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金、富国收益宝货币市场基金、

富国中小盘精选混合型证券投资基金、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金、富国文体健康股票型证券投资基金、富国国家安全主题混合型证券投资基金、富国改革动力混合型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育指数分级证券投资基金等六十四只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贺轶	本基金基金经理兼任权益投资副总监	2012-09-08	-	13 年	硕士，曾任中国银行云南省分行国际业务部银行职员；菲利普证券公司分析员；中银国际证券有限责任公司资产管理部分析员；中银基金管理有限公司投资部助理副总裁；汇丰晋信基金管理公司投资管理部投资经理、基金经理；富国基金管理有限公司营销策划与产品部高级营销策划经理、权益投资部策略分析师；2010 年 1 月至 2014 年 1 月任汉盛证券投资基金基金经理，2012 年 9 月起任富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金基金经理；兼任权益投资副总监。具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。
2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金持有的平安转债未在赎回登记日前及时转股或卖出，形成亏损。本基金管理人已动用自有资金对基金资产进行赔付，保证基金持有人利益不受损失。本基金管理人也已加强相关程序控制，以避免此类事件的发生。除此之外，本基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金基金合同》以及其它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，以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，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投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，监察稽核部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现 17 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年，A 股市场在增量资金持续入市、政策宽松和改革预期等因素的影响下，市场呈现整体上升态势，但在 2 季度季末阶段，在市场资金去杠杆效应的影响下，A 股市场快速大幅下跌。2015 年上半年，本基金继续根据宏观经济和股票市场状况对权益类资产的配置比例进行动态调整。行业配置重点仍然是以受益于经济中长期发展主题和改革红利释放、业绩增速确定性较高以及估值较合理的行业为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日，本基金份额净值为1.2581元，份额累计净值为4.7486元；本报告期，本基金份额净值增长率为 49.46%，同期业绩比较基准收益率为23.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，预计国内宏观经济增速将在前期稳增长政策作用下呈现逐步企稳的态势，市场资金供需的新平衡处于重建过程中，A股市场总体走势将以震荡分化为主。本基金仍将积极关注受益于经济中长期发展主题的行业的投资机会。本基金感谢投资者的信任和支持，我们将勤勉尽责，坚持价值投资理念，努力把握行业、公司和市场机会，争取为投资者创造更大的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作，保证基金估值的公允性和合理性，维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员，必须列席估值委员会的定期会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本基金于 2015 年 01 月 16 日公告对 2014 年度利润进行收益分配，每 10 份基金份额分配红利 0.87 元，共计派发红利 305,548,449.87 元。本基金将严格按照相关法律法规以及本基金《基金合同》的约定进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期无需要说明的相关情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—富国基金管理有限公司本报告期基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，富国基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 （2015 年 06 月 30 日）	上年度末 （2014 年 12 月 31 日）
资 产：		
银行存款	162,237,596.87	377,018,605.43
结算备付金	14,278,526.47	13,811,035.33
存出保证金	1,608,289.61	1,564,470.80
交易性金融资产	1,987,790,655.02	3,045,879,188.89
其中：股票投资	1,987,790,655.02	3,042,306,872.89
基金投资	-	-
债券投资	-	3,572,316.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	46,436,993.71	-
应收利息	36,207.78	83,312.93
应收股利	-	-
应收申购款	3,096,790.88	376,018.14
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,215,485,060.34	3,438,732,631.52
负债和所有者权益	**本期末**	**上年度末**

	（2015 年 06 月 30 日）	（2014 年 12 月 31 日）
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	24,877,615.53
应付赎回款	91,216,762.54	17,075,502.69
应付管理人报酬	3,314,980.14	4,498,660.80
应付托管费	552,496.68	749,776.82
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,587,760.42	8,554,773.68
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	690,934.86	477,442.01
负债合计	103,362,934.64	56,233,771.53
所有者权益：		
实收基金	707,491,361.94	1,540,499,214.05
未分配利润	1,404,630,763.76	1,841,999,645.94
所有者权益合计	2,112,122,125.70	3,382,498,859.99
负债和所有者权益总计	2,215,485,060.34	3,438,732,631.52

注：报告截止日 2015 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2581 元，基金份额总额 1,678,853,133.90 份。

6.2 利润表

会计主体：富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 01 月 01 日至 2015 年 06 月 30 日

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）
一、收入	1,359,584,268.43	-121,572,191.51
1.利息收入	1,298,485.94	4,886,037.54
其中：存款利息收入	1,057,963.99	2,574,317.24
债券利息收入	481.71	1,032,442.84
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	240,040.24	1,279,277.46
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,467,574,552.94	68,205,534.72

其中：股票投资收益	1,455,883,538.68	32,845,201.43
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,335,708.00	1,419,000.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具投资收益	-	-
股利收益	10,355,306.26	33,941,333.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-112,519,726.14	-195,631,225.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	3,230,955.69	967,461.51
减：二、费用	51,472,300.58	54,872,628.39
1．管理人报酬	22,578,895.96	30,370,991.07
2．托管费	3,763,149.30	5,061,831.81
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	24,912,880.84	19,217,995.72
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6．其他费用	217,374.48	221,809.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,308,111,967.85	-176,444,819.90
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,308,111,967.85	-176,444,819.90

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 01 月 01 日至 2015 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 （2015 年 01 月 01 日至 2015 年 06 月 30 日）		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,540,499,214.05	1,841,999,645.94	3,382,498,859.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,308,111,967.85	1,308,111,967.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-833,007,852.11	-1,439,932,400.16	-2,272,940,252.27
其中：1.基金申购款	151,964,842.39	235,644,855.66	387,609,698.05
2.基金赎回款	-984,972,694.50	-1,675,577,255.82	-2,660,549,950.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-305,548,449.87	-305,548,449.87

五、期末所有者权益（基金净值）	707,491,361.94	1,404,630,763.76	2,112,122,125.70
项目	上年度可比期间 （2014 年 01 月 01 日至 2014 年 06 月 30 日）		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,421,043,827.84	2,465,164,697.96	4,886,208,525.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-176,444,819.90	-176,444,819.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-309,429,284.49	-286,022,895.04	-595,452,179.53
其中：1.基金申购款	114,401,111.44	96,109,000.73	210,510,112.17
2.基金赎回款	-423,830,395.93	-382,131,895.77	-805,962,291.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-286,373,703.41	-286,373,703.41
五、期末所有者权益（基金净值）	2,111,614,543.35	1,716,323,279.61	3,827,937,822.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署；

陈戈	林志松	雷青松
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2005]20 号文《关于同意富国天瑞强势地区精选混合型开放式证券投资基金募集的批复》的核准，由富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2005 年 4 月 5 日正式生效，首次设立募集规模为 1,638,678,558.87 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中债券包括国债、金融债、企业（公司）债（包括可转债）等。本基金的业绩比较基准为：上证 A 股指数收益率×70%＋上证国债指数收益率×25%＋同业存款利率×5%。

2008 年 1 月 17 日（拆分日），本基金管理人富国基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分前，本基金的基金份额净值为人民币 2.3729 元，根据基金份额拆分公式，计算精确到小数点后第 9 位（第 9 位以后舍去）为人民币 2.372939797 元。本基金管理人于拆分日，按照 1:2.372939797 的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后，基金份额净值为人民币 1.0000 元，基金份额面值为

人民币 0.4214 元。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下文 6.4.5.2 会计估计变更的说明中的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定， 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

6.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

根据证监许可[2015]95 号《关于核准设立申万宏源证券有限公司及其 2 家子公司的批复》的批准，中国证券监督管理委员会同意申银万国证券股份有限公司以吸收合并宏源证券股份有限公司后的全部证券类资产及负债出资设立全资证券子公司申万宏源证券有限公司。相应的，本公司的股东自 2015 年 1 月 16 日起由申银万国证券股份有限公司变更为申万宏源证券有限公司。相关变更手续尚在办理当中。变更后，本公司的股东为海通证券股份有限公司，出资比例为 27.775%；申万宏源证券有限公司，出资比例为 27.775%；蒙特利尔银行，出资比例为 27.775%；山东省国际信托有限公司，出资比例为 16.675%。

6.4.7.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。关联方申万宏源证券有限公司（简称“申万宏源”）是由原关联方申银万国证券股份有限公司与宏源证券股份有限公司于 2015 年 1 月 16 日合并组建而成。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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）	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
海通证券	80,920,069.75	0.51	982,718,162.39	7.92
申万宏源	312,035,173.20	1.98	-	-
申银万国	-	-	643,591,335.58	5.19

注：关联方申万宏源证券有限公司（简称“申万宏源”）是由原关联方申银万国证券股份有限公司与宏源证券股份有限公司于 2015 年 1 月 16 日合并组建而成。上表显示的本期申万宏源交易额为通过申万宏源证券席位交易的总额，申银万国交易额为上年度可比期间通过原关联方申银万国证券席位交易的总额。

6.4.8.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
海通证券	-	-	150,000,000.00	14.13
申万宏源	109,100,000.00	30.38	-	-

注：关联方申万宏源证券有限公司（简称“申万宏源”）是由原关联方申银万国证券股份有限公司与宏源证券股份有限公司于 2015 年 1 月 16 日合并组建而成。上表显示的本期申万宏源交易额为通过申万宏源证券席位交易的总额，申银万国

交易额为上年度可比期间通过原关联方申银万国证券席位交易的总额。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2015年01月01日至2015年06月30日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
申万宏源	284,076.79	2.02	159,153.03	2.10
海通证券	73,668.74	0.52	73,668.74	0.97
关联方名称	上年度可比期间（2014年01月01日至2014年06月30日）			
	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
海通证券	894,662.74	8.04	574,005.82	11.26
申银万国	585,921.90	5.27	201,753.28	3.96

注：1、上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。
2、关联方申万宏源证券有限公司（简称“申万宏源”）是由原关联方申银万国证券股份有限公司与宏源证券股份有限公司于 2015 年 1 月 16 日合并组建而成。上表显示的本期申万宏源交易额为通过申万宏源证券席位交易的总额，申银万国交易额为上年度可比期间通过原关联方申银万国证券席位交易的总额。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

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）
当期发生的基金应支付的管理费	22,578,895.96	30,370,991.07
其中：支付销售机构的客户维护费	4,281,726.18	5,490,331.80

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.50%/当年天数

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

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）
当期发生的基金应支付的托管费	3,763,149.30	5,061,831.81

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/当年天数

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度可比期间末本基金除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	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）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	162,237,596.87	939,336.42	699,585,346.63	2,477,620.19

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

6.4.9 期末（2015 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300147	香雪制药	2015-06-18	2015-07-02	配股	10.46	30.80	234,719	2,455,160.74	7,229,345.20	

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

						价				
000008	神州高铁	2015-03-12	筹划重大事项	26.87	2015-07-02	29.56	1,062,785	24,330,912.85	28,557,032.95	
000024	招商地产	2015-04-03	筹划重大事项	31.64		-	1,888,650	31,518,601.51	59,756,886.00	
000566	海南海药	2015-06-18	筹划重大事项	49.97		-	419,220	19,566,583.47	20,948,423.40	
002080	中材科技	2015-04-21	筹划重大事项	22.79		-	239,900	6,156,545.00	5,467,321.00	
002170	芭田股份	2015-05-26	筹划重大事项	26.12	2015-07-28	23.51	9,300	77,655.00	242,916.00	
002191	劲嘉股份	2015-06-18	筹划重大事项	19.22		-	954,632	11,257,250.27	18,348,027.04	
002223	鱼跃医疗	2015-06-25	筹划重大事项	67.20	2015-07-13	60.48	1,013,225	26,108,030.17	68,088,720.00	
002268	卫士通	2015-05-08	筹划重大事项	84.80	2015-08-04	76.32	235,400	19,390,224.00	19,961,920.00	
002367	康力电梯	2015-06-02	筹划重大事项	28.49		-	932,100	21,749,199.69	26,555,529.00	
002375	亚厦股份	2015-06-17	筹划重大事项	29.21	2015-07-20	26.29	445,567	10,788,421.97	13,015,012.07	
002445	中南重工	2015-06-02	筹划重大事项	51.39		-	539,300	27,764,438.19	27,714,627.00	
002727	一心堂	2015-04-13	筹划重大事项	78.24	2015-08-17	70.42	182,944	9,733,178.90	14,313,538.56	
300008	上海佳豪	2015-03-24	筹划重大事项	17.24		-	1,141,862	18,634,186.88	19,685,700.88	
300161	华中数控	2015-05-22	筹划重大事项	38.20		-	413,300	15,805,374.75	15,788,060.00	
300203	聚光科技	2015-04-20	筹划重大事项	37.68	2015-08-12	33.88	576,480	12,371,901.97	21,721,766.40	
300287	飞利信	2015-06-02	筹划重大事项	38.08		-	499,224	19,632,622.09	19,010,449.92	
600310	桂东电力	2015-06-30	筹划重大事项	31.53	2015-07-13	34.68	577,730	18,449,005.59	18,215,826.90	
600645	中源协和	2015-04-27	筹划重大事项	79.34		-	243,420	14,182,486.81	19,312,942.80	
600654	中安消	2015-06-29	筹划重大事项	30.91		-	381,300	16,403,026.49	11,785,983.00	
600886	国投电力	2015-06-24	筹划重大事项	14.87		-	392,000	5,158,720.00	5,829,040.00	
600978	宜华木业	2015-06-18	筹划重大事项	22.44		-	768,500	17,642,064.40	17,245,140.00	
601021	春秋航空	2015-06-26	筹划重大事项	126.09	2015-07-21	113.48	470,037	47,503,490.48	59,266,965.33	

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 1,469,729,481.57 元，属于第二层次的余额为人民币 518,061,173.45 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元。

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,987,790,655.02	89.72
	其中：股票	1,987,790,655.02	89.72
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	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资	-	-

	产		
6	银行存款和结算备付金合计	176,516,123.34	7.97
7	其他各项资产	51,178,281.98	2.31
8	合计	2,215,485,060.34	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,158,337,876.82	54.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,359,079.40	1.53
E	建筑业	39,326,856.23	1.86
F	批发和零售业	69,383,185.57	3.28
G	交通运输、仓储和邮政业	125,435,862.86	5.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	208,359,811.14	9.86
J	金融业	149,555,268.80	7.08
K	房地产业	92,071,587.48	4.36
L	租赁和商务服务业	13,811,966.67	0.65
M	科学研究和技术服务业	38,998,643.68	1.85
N	水利、环境和公共设施管理业	39,761,319.81	1.88
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	11,376,740.56	0.54
S	综合	9,012,456.00	0.43
	合计	1,987,790,655.02	94.11

7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	4,753,930	82,005,292.50	3.88
2	002223	鱼跃医疗	1,013,225	68,088,720.00	3.22
3	002366	丹甫股份	820,784	60,229,129.92	2.85
4	000024	招商地产	1,888,650	59,756,886.00	2.83
5	601021	春秋航空	470,037	59,266,965.33	2.81
6	300285	国瓷材料	1,643,420	58,670,094.00	2.78
7	002153	石基信息	379,665	49,352,653.35	2.34
8	600115	东方航空	3,892,737	47,958,519.84	2.27
9	300253	卫宁软件	886,714	46,109,128.00	2.18
10	300156	神雾环保	1,044,102	45,407,995.98	2.15

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的半年度报告正文

7.4 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

金额单位：人民币元

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	601318	中国平安	154,207,579.06	4.56
2	600048	保利地产	116,783,857.14	3.45
3	601688	华泰证券	115,172,180.78	3.40
4	000001	平安银行	110,120,055.03	3.26
5	000002	万科 A	99,656,676.13	2.95
6	300253	卫宁软件	97,185,498.71	2.87
7	601988	中国银行	89,545,829.91	2.65
8	300075	数字政通	82,262,471.93	2.43
9	601601	中国太保	74,652,535.71	2.21
10	300352	北信源	67,367,591.01	1.99
11	601021	春秋航空	67,014,835.35	1.98
12	300212	易华录	60,715,911.32	1.80
13	600703	三安光电	59,162,061.37	1.75
14	300204	舒泰神	58,738,417.84	1.74
15	600588	用友网络	58,317,044.14	1.72
16	300018	中元华电	56,549,633.10	1.67
17	601169	北京银行	54,489,279.85	1.61
18	300287	飞利信	54,029,851.68	1.60
19	601377	兴业证券	52,673,523.82	1.56
20	002268	卫士通	52,459,338.06	1.55

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600048	保利地产	190,097,212.02	5.62
2	601318	中国平安	181,398,733.10	5.36
3	000001	平安银行	147,648,279.33	4.37
4	000002	万科 A	146,240,972.95	4.32
5	601601	中国太保	137,719,996.03	4.07
6	300253	卫宁软件	134,905,588.59	3.99
7	300059	东方财富	124,087,222.10	3.67
8	601688	华泰证券	111,182,400.11	3.29

9	600703	三安光电	101,419,387.02	3.00
10	600000	浦发银行	91,300,870.34	2.70
11	600570	恒生电子	89,972,095.00	2.66
12	601988	中国银行	89,539,737.39	2.65
13	000671	阳光城	87,565,234.77	2.59
14	601328	交通银行	84,643,354.75	2.50
15	601628	中国人寿	83,993,634.02	2.48
16	300075	数字政通	83,578,365.44	2.47
17	002024	苏宁云商	78,998,368.23	2.34
18	601299	中国北车	74,594,725.16	2.21
19	300352	北信源	74,298,667.66	2.20
20	002563	森马服饰	73,644,136.54	2.18
21	600340	华夏幸福	72,634,886.09	2.15
22	000581	威孚高科	70,318,020.86	2.08
23	300212	易华录	70,301,345.82	2.08
24	601668	中国建筑	67,683,334.59	2.00

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,692,231,988.21
卖出股票收入（成交）总额	9,089,944,457.18

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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。

7.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 申明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。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,608,289.61
2	应收证券清算款	46,436,993.71
3	应收股利	-
4	应收利息	36,207.78
5	应收申购款	3,096,790.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,178,281.98

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002223	鱼跃医疗	68,088,720.00	3.22	筹划重大事项
2	000024	招商地产	59,756,886.00	2.83	筹划重大事项
3	601021	春秋航空	59,266,965.33	2.81	筹划重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
87364	19,216.76	55,842,444.82	3.33	1,623,010,689.08	96.67

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理公司所有从业人员持有本基金	570,500.76	0.0340

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2005 年 04 月 05 日)基金份额总额	1,638,678,558.87
报告期期初基金份额总额	3,655,553,201.84

本报告期基金总申购份额	360,606,276.60
减：本报告期基金总赎回份额	2,337,306,344.54
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,678,853,133.90

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期内，本基金管理人已于 2015 年 1 月 10 日发布公告，李笑薇女士、朱少醒先生自 2015 年 1 月 9 日起担任公司副总经理。

本基金管理人已于 2015 年 1 月 31 日发布公告，薛爱东先生自 2015 年 1 月 30 日起担任公司董事长。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期权证成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
渤海证券	2	-	0.00	-	0.00	-	0.00	-	0.00	-	0.00	
川财证券	2	4,306,190,982.58	27.30	-	0.00	-	0.00	-	0.00	3,831,482.53	27.26	
东方证券	2	515,134,500.80	3.27	-	0.00	-	0.00	-	0.00	464,193.06	3.30	
东海证券	1	-	0.00	-	0.00	-	0.00	-	0.00	-	0.00	
高华证券	2	757,679,489.94	4.80	-	0.00	150,000,000.00	41.77	-	0.00	684,745.97	4.87	
国金证券	2	568,417,147.38	3.60	-	0.00	-	0.00	-	0.00	511,101.92	3.64	
国信证券	1	74,368,563.29	0.47	-	0.00	-	0.00	-	0.00	65,808.92	0.47	
国元证券	1	-	0.00	-	0.00	-	0.00	-	0.00	-	0.00	
海通证券	1	80,920,069.75	0.51	-	0.00	-	0.00	-	0.00	73,668.74	0.52	
华泰证券	1	2,128,606,275.46	13.49	-	0.00	-	0.00	-	0.00	1,883,605.32	13.40	
瑞银证券	1	-	0.00	-	0.00	-	0.00	-	0.00	-	0.00	
申万宏源	1	312,035,173.20	1.98	-	0.00	109,100,000.00	30.38	-	0.00	284,076.79	2.02	
招商证券	1	4,856,829,766.63	30.79	-	0.00	-	0.00	-	0.00	4,297,812.31	30.58	
中金公司	1	928,408,157.65	5.88	-	0.00	-	0.00	-	0.00	821,549.52	5.85	
中信建投	1	1,247,611,403.09	7.91	-	0.00	100,000,000.00	27.85	-	0.00	1,135,822.53	8.08	

中银国际	1	-	0.00	-	0.00	-	0.00	-	0.00	-	0.00	

注：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。

2.本期内本基金租用的券商交易单元无变更。