

上证综指交易型开放式指数证券投资基金
二〇一六年半年度报告

2016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： 中国工商银行股份有限公司

送出日期： 2016年08月25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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
§4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6	半年度财务报表(未经审计).....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	16
6.4	报表附注.....	17
§7	投资组合报告.....	32
7.1	期末基金资产组合情况.....	32
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3	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.....	34
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	40
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.....	40
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.....	40

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12	投资组合报告附注	41
§8	基金份额持有人信息	42
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2	期末上市基金前十名持有人	42
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.4	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	43
§9	开放式基金份额变动	43
§10	重大事件揭示	43
10.1	基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4	基金投资策略的改变	44
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8	其他重大事件	46
§11	备查文件目录	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证综指交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	上证综指 ETF
场内简称	综指 ETF
基金主代码	510210
交易代码	510210
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2011 年 01 月 30 日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	42,638,513.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 3 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数（上证综合指数），追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标指数的紧密跟踪。
业绩比较基准	上证综合指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金，跟踪上证综合指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	范伟隽	洪渊
	联系电话	021-20361818	010—66105799
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	95588
传真		021-20361616	010—66105798
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	楼	
办公地址	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	薛爱东	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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楼 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§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(2016年01月01日至2016年06月30日)
本期已实现收益	-3,107,168.05
本期利润	-27,410,125.08
加权平均基金份额本期利润	-0.6308
本期加权平均净值利润率	-19.64%
本期基金份额净值增长率	-15.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年06月30日)
期末可供分配利润	13,901,925.88
期末可供分配基金份额利润	0.3260

期末基金资产净值	138,491,533.55
期末基金份额净值	3.248
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年06月30日)
基金份额累计净值增长率	11.16%

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。

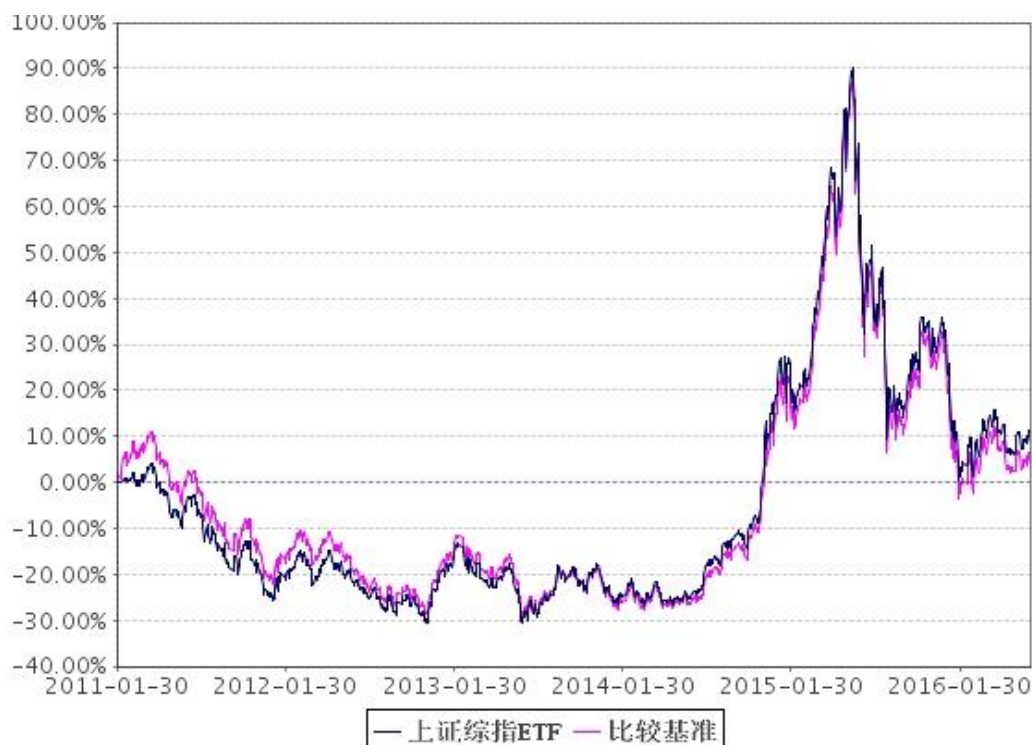
期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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	0.87%	0.94%	0.45%	1.02%	0.42%	-0.08%
过去三个月	-1.61%	1.05%	-2.47%	1.10%	0.86%	-0.05%
过去六个月	-15.83%	1.84%	-17.22%	1.93%	1.39%	-0.09%
过去一年	-29.62%	2.19%	-31.51%	2.30%	1.89%	-0.11%
过去三年	57.29%	1.76%	48.02%	1.79%	9.27%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	11.16%	1.51%	6.42%	1.53%	4.74%	-0.02%

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2016年6月30日。

2、本基金于2011年1月30日成立，建仓期3个月，从2011年1月30日起至2011年4月29日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 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2016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、富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值混合型证券投资基金、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、富国天合稳健优选混合型证券投资基金、富国天博创新主题混合型证券投资基金、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

动混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、富国低碳环保混合型证券投资基金、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、富国高新技术产业混合型证券投资基金、富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金、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、富国稳健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、富国医疗保健行业混合型证券投资基金、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、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金、富国新动力灵活配置混合型证券投资基金、富国收益宝交易型货币市场基金、富国低碳新经济混合型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国研究优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金、富国价值优势混合型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国美丽中国混合型证券投资基金、富国创新科技混合型证券投资基金等七十四只证券投资基金。

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		
方旻	本基金基金经理兼任量化投资副总监、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强	2014-11-19	—	6 年	硕士，自 2010 年 2 月至 2014 年 4 月任富国基金管理有限公司定量研究员；2014 年 4 月至 2014 年 11 月任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理助理，2014 年 11 月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券

	证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、富国创业板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、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理				投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金和富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,2015年5月起任富国创业板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及富国中证银行指数分级证券投资基金的基金经理,2015年10月起任富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;兼任量化投资副总监。具有基金从业资格。
王保合	本基金基金经理兼任量化投资部总经理、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国中证军工指数分级证券	2011-03-03	—	10年	博士,曾任富国基金管理有限公司研究员、富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理;2011年3月起任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基金经理,2013年9月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理,2014年4月起任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理,2015年4月起任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基金经理,2015年5月起任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

	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基金经理				级证券投资基金基金经理；兼任量化投资部总经理。具有基金从业资格。
--	---	--	--	--	----------------------------------

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；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，富国基金管理有限公司作为上证综指交易型开放式指数证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《上证综指交易型开放式指数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，确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，管理和运用基金资产，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未出现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

2016年初以来，受人民币汇率快速贬值的影响同时叠加美联储加息预期，投资者预计国内流动性进一步宽松的环境受到限制，A股市场再次出现大幅调整。随着2月公布的1月信贷数据大幅超预期，同时人民币汇率逐步企稳，投资者对货币宽松预期加强，市场经过充分调整之后迎来反弹。尽管4月初公布的一季度经济数据表明经济正在阶段性复苏，但总体符合市场一致预期，因此对市场的刺激作用有限。4月中旬以来，央行研究局马骏表示“央行未来的货币政策操作，除了要继续支持实现稳增长的目标，也要注意防范宏观风险，尤其是要避免企业杠杆率过快上升，还要考虑到货币信贷增长对未来物价走势和房地产价格的影响”，引起市场对货币政策收紧的担忧，同时叠加债券市场的信用风险暴露，4月下旬A股市场迎来一轮调整。由于自2015年6月以来，A股已经历大幅调整，市场进一步向下空间有限，A股迎来窄幅震荡行情，同时伴随着市场成交量快速萎缩。从结构来看，由于市场风险偏好下降，部分景气度向上的行业如新能源汽车、食品饮料、电子等获得了市场青睐，表现相对较好。总体来看，2016年上半年沪深300指数下跌15.47%，上证综指下跌17.22%，创业板指下跌17.92%。

在投资管理上，本基金采取完全复制的被动式指数基金管理策略，采用量化和人工管理相结合的方法，处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 3.248 元,份额累计净值为 1.112 元;本报告期,本基金份额净值增长率为-15.83%,同期业绩比较基准收益率为-17.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,自英国脱欧,美联储加息延后以来,全球货币宽松预期逐步加强。然而,7 月英国、欧洲央行均维持利率不变,日本央行表示不会进行直升机撒钱,全球货币进一步宽松的预期已被阶段性证伪。从国内政策看,央行官员也表达了对“流动性陷阱”的担忧,后续国内货币政策进一步宽松的概率也在下降。在增量资金进场之前,市场仍将处于存量博弈的环境中,估值会成为市场上涨和下跌的重要约束。总体来看,预计市场仍将以震荡为主,继续关注结构性机会,业绩有望明确向好的新能源汽车、食品饮料等行业仍值得重点关注。

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投资基金行业从业经验。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,本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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

本报告期内,本基金托管人在对上证综指交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，上证综指交易型开放式指数证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在上证综指交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，上证综指交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的上证综指交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部
2016 年 8 月 23 日

§ 6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2016 年 06 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
资产：		
银行存款	3,931,302.68	3,662,145.33
结算备付金	—	6,758.26
存出保证金	1,055.23	17,848.00
交易性金融资产	134,799,990.86	169,000,374.03
其中：股票投资	134,799,990.86	169,000,374.03
基金投资	—	—
债券投资	—	—
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	—	—
应收利息	736.96	1,400.94
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—

其他资产	—	—
资产总计	138,733,085.73	172,688,526.56
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	(2016年06月30日)	(2015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	—	109.55
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	56,043.66	73,715.48
应付托管费	11,208.73	14,743.08
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	24,845.89	15,666.45
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	149,453.90	310,000.00
负债合计	241,552.18	414,234.56
所有者权益:		
实收基金	124,589,607.67	130,433,601.70
未分配利润	13,901,925.88	41,840,690.30
所有者权益合计	138,491,533.55	172,274,292.00
负债和所有者权益总计	138,733,085.73	172,688,526.56

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.248 元，基金份额总额 42,638,513.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 01 月 01 日至 2016 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2016年01月01日至 2016年06月30日)	上年度可比期间 (2015年01月01日至 2015年06月30日)
一、收入	-26,753,024.12	38,256,930.37
1. 利息收入	10,953.74	20,261.38
其中：存款利息收入	10,943.94	20,219.53
债券利息收入	9.80	41.85
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—

其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-2,461,020.83	113,659,577.09
其中：股票投资收益	-3,827,098.43	112,110,872.95
基金投资收益	—	—
债券投资收益	17,826.20	110,307.40
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	1,348,251.40	1,438,396.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-24,302,957.03	-76,143,223.01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	—	720,314.91
减：二、费用	657,100.96	1,123,191.50
1. 管理人报酬	347,388.36	636,403.63
2. 托管费	69,477.65	127,280.77
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	40,615.05	100,451.45
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	199,619.90	259,055.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-27,410,125.08	37,133,738.87
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-27,410,125.08	37,133,738.87

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证综指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016年01月01日至2016年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2016年01月01日至2016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）	130,433,601.70	41,840,690.30	172,274,292.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-27,410,125.08	-27,410,125.08
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）	-5,843,994.03	-528,639.34	-6,372,633.37
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	-5,843,994.03	-528,639.34	-6,372,633.37

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）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	124,589,607.67	13,901,925.88	138,491,533.55
项目	上年度可比期间 (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）	204,944,525.40	44,489,744.19	249,434,269.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	37,133,738.87	37,133,738.87
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）	0.27	37,098,628.02	37,098,628.29
其中：1. 基金申购款	1,105,975,868.77	810,302,495.90	1,916,278,364.67
2. 基金赎回款	-1,105,975,868.50	-773,203,867.88	-1,879,179,736.38
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）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	204,944,525.67	118,722,111.08	323,666,636.75

注：所附附注为本会计报表的组成部分。

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

基金管理人负责人

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

上证综指交易型开放式指数证券投资基金（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”）证监许可[2010]1379号《关于核准上证综指交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集，基金合同于2011年1月30日正式生效，首次设立募集规模为320,363,407.00份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%。如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在

10 个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

本基金业绩比较基准为标的指数。

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 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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，也参考了中国证券业协会制定的《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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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

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[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、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

3. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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。

4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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[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[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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于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2015年9月8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，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2016年06月30日）
活期存款	3,931,302.68
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	3,931,302.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2016年06月30日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	149,523,302.63	134,799,990.86	-14,723,311.77
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	149,523,302.63	134,799,990.86	-14,723,311.77

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2016年06月30日）
应收活期存款利息	736.46
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	—

应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	0.50
合计	736.96

6.4.7.6其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2016年06月30日）
交易所市场应付交易费用	24,845.89
银行间市场应付交易费用	—
合计	24,845.89

6.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2016年06月30日）
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提上市年费	29,835.26
预提审计费	24,863.02
预提信息披露费	44,755.62
应付指数使用费	50,000.00
合计	149,453.90

6.4.7.9实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2016年01月01日至2016年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,638,513.00	130,433,601.70
本期申购	—	-
本期赎回（以“-”号填列）	-2,000,000.00	-5,843,994.03
本期末	42,638,513.00	124,589,607.67

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,346,020.03	13,494,670.27	41,840,690.30
本期利润	-3,107,168.05	-24,302,957.03	-27,410,125.08
本期基金份额交易产生的变动数	-1,253,253.50	724,614.16	-528,639.34
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	-1,253,253.50	724,614.16	-528,639.34
本期已分配利润	—	—	—
本期末	23,985,598.48	-10,083,672.60	13,901,925.88

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2016年01月01日至2016年06月30日）
活期存款利息收入	10,874.10
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	43.62
其他	26.22
合计	10,943.94

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期（2016年01月01日至2016年06月30日）
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,937,705.45
股票投资收益——赎回差价收入	-889,392.98
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	-3,827,098.43

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2016年01月01日至2016年06月30日）
卖出股票成交总额	13,402,422.00
减：卖出股票成本总额	16,340,127.45
买卖股票差价收入	-2,937,705.45

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.12.4 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期（2016年01月01日至2016年06月30日）
赎回基金份额对价总额	6,372,633.37
减：现金支付赎回款总额	165,307.37
减：赎回股票成本总额	7,096,718.98
赎回差价收入	-889,392.98

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2016年01月01日至2016年06月30日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	118,836.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	101,000.00
减：应收利息总额	9.80
买卖债券差价收入	17,826.20

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2016年01月01日至2016年06月30日）
股票投资产生的股利收益	1,348,251.40
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,348,251.40

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期（2016年01月01日至2016年06月30日）
1. 交易性金融资产	-24,302,957.03
股票投资	-24,302,957.03
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
合计	-24,302,957.03

6.4.7.19 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2016年01月01日至2016年06月30日）
交易所市场交易费用	40,615.05
银行间市场交易费用	—
合计	40,615.05

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2016年01月01日至2016年06月30日）
审计费用	24,863.02
信息披露费	44,755.62
银行汇划费用	166.00
指数使用费	100,000.00
上市费	29,835.26
合计	199,619.90

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2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、基金销售机构
富国上证综指交易型开放式指数证券投资 基金联接基金	本基金的联接基金
中国工商银行股份有限公司	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2016年01月01日至 2016年06月30日）	上年度可比期间（2015年01月 01日至2015年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	347,388.36	636,403.63
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2016年01月01日至 2016年06月30日)	上年度可比期间(2015年01月 01日至2015年06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	69,477.65	127,280.77

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末(2016年06月30日)		上年度末(2015年12月31日)	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例(%)	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例(%)
富国上证综指交易 型开放式指数证券 投资基金联接基金	—	—	38,900,000.00	87.14

6.4.10.5 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(2016年01月01日至2016年06月30 日)		上年度可比期间(2015年01月01日至2015 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
中国工商银行股份有限 公司	3,931,302.68	10,874.10	19,039,807.35	19,450.46

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600019	宝钢股份	2016-06-27	重大事项停牌	4.90	—	—	78,900	496,555.59	386,610.00	—
600497	驰宏锌锗	2016-06-09	重大事项停牌	9.97	2016-07-11	10.97	28,073	305,974.96	279,887.81	—
600751	天海投资	2016-02-15	重大事项停牌	6.11	2016-07-26	6.72	44,500	357,719.67	271,895.00	—
601168	西部矿业	2016-02-01	重大事项停牌	5.93	2016-07-22	6.52	47,500	338,071.07	281,675.00	—

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2016 年 06 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证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 06 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证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、

监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2016年06月30日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,931,302.68	—	—	—	—	—	3,931,302.68
存出保证金	1,055.23	—	—	—	—	—	1,055.23
交易性金融资产	—	—	—	—	—	134,799,990.86	134,799,990.86
应收利息	—	—	—	—	—	736.96	736.96
资产总计	3,932,357.91	—	—	—	—	134,800,727.82	138,733,085.73
负债							
卖出回购金融资产款	—	—	—	—	—	—	—
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	56,043.66	56,043.66
应付托管费	—	—	—	—	—	11,208.73	11,208.73
应付交易费用	—	—	—	—	—	24,845.89	24,845.89
其他负债	—	—	—	—	—	149,453.90	149,453.90
负债总计	—	—	—	—	—	241,552.18	241,552.18
利率敏感度缺口	3,932,357.91	—	—	—	—	134,559,175.64	138,491,533.55
上年度末（2015年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,662,145.33	—	—	—	—	—	3,662,145.33
结算备付金	6,758.26	—	—	—	—	—	6,758.26
存出保证金	17,848.00	—	—	—	—	—	17,848.00
交易性金融资产	—	—	—	—	—	169,000,374.03	169,000,374.03

应收利息	—	—	—	—	—	1,400.94	1,400.94
资产总计	3,686,751.59	—	—	—	—	169,001,774.97	172,688,526.56
负债							
卖出回购金融资产款	—	—	—	—	—	—	—
应付证券清算款	—	—	—	—	—	109.55	109.55
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	73,715.48	73,715.48
应付托管费	—	—	—	—	—	14,743.08	14,743.08
应付交易费用	—	—	—	—	—	15,666.45	15,666.45
其他负债	—	—	—	—	—	310,000.00	310,000.00
负债总计	—	—	—	—	—	414,234.56	414,234.56
利率敏感度缺口	3,686,751.59	—	—	—	—	168,587,540.41	172,274,292.00

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券(不含可转债)，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2016年06月30日）		上年度末（2015年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	134,799,990.86	97.33	169,000,374.03	98.10
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	134,799,990.86	97.33	169,000,374.03	98.10

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：元）	
		本期末（2016年06月30日）	上年度末（2015年12月31日）

	1. 业绩比较基准增加 1%	1,311,988.77	1,685,527.49
	2. 业绩比较基准减少 1%	-1,311,988.77	-1,685,527.49

6.4.14 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 2016 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 133,579,923.05 元，属于第二层次的余额为人民币 1,220,067.81 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	134,799,990.86	97.16

	其中：股票	134,799,990.86	97.16
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	3,931,302.68	2.83
7	其他各项资产	1,792.19	—
8	合计	138,733,085.73	100.00

注：上表中的股票投资项的金额包含可退替代款估值增值，而 5.3 的合计项不含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合：

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.2 指数投资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	1,162,060.00	0.84
B	采矿业	16,167,368.84	11.67
C	制造业	41,191,096.69	29.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,352,581.29	5.31
E	建筑业	5,720,002.57	4.13
F	批发和零售业	4,074,515.60	2.94
G	交通运输、仓储和邮政业	7,166,932.58	5.17
H	住宿和餐饮业	438,228.00	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,838,714.36	2.05
J	金融业	38,789,301.94	28.01
K	房地产业	6,226,919.45	4.50
L	租赁和商务服务业	316,656.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	825,729.54	0.60
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	1,918,532.00	1.39
S	综合	611,352.00	0.44
	合计	134,799,990.86	97.33

7.3 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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601857	中国石油	987,658	7,140,767.34	5.16
2	601288	农业银行	1,598,439	5,115,004.80	3.69
3	601988	中国银行	1,224,500	3,930,645.00	2.84
4	601628	中国人寿	129,743	2,701,249.26	1.95
5	600028	中国石化	564,888	2,666,271.36	1.93
6	601166	兴业银行	144,670	2,204,770.80	1.59
7	600036	招商银行	118,422	2,072,385.00	1.50
8	600000	浦发银行	130,284	2,028,521.88	1.46
9	600519	贵州茅台	6,893	2,012,204.56	1.45
10	600016	民生银行	206,180	1,841,187.40	1.33
11	601318	中国平安	56,600	1,813,464.00	1.31
12	601328	交通银行	308,120	1,734,715.60	1.25
13	601169	北京银行	143,690	1,490,065.30	1.08
14	600104	上汽集团	69,600	1,412,184.00	1.02
15	601009	南京银行	144,540	1,357,230.60	0.98
16	601088	中国神华	95,621	1,345,387.47	0.97
17	601998	中信银行	233,060	1,321,450.20	0.95
18	600900	长江电力	98,695	1,232,700.55	0.89
19	600606	绿地控股	111,600	1,207,512.00	0.87
20	600015	华夏银行	119,956	1,186,364.84	0.86
21	600360	华微电子	100,000	1,186,000.00	0.86
22	600682	南京新百	41,600	1,184,352.00	0.86
23	601818	光大银行	313,700	1,179,512.00	0.85
24	601238	广汽集团	45,200	1,061,748.00	0.77
25	601766	中国中车	110,664	1,014,788.88	0.73
26	601601	中国太保	37,300	1,008,592.00	0.73
27	601800	中国交建	95,669	1,007,394.57	0.73
28	600030	中信证券	60,712	985,355.76	0.71
29	601668	中国建筑	180,600	960,792.00	0.69
30	600663	陆家嘴	39,352	895,258.00	0.65
31	600116	三峡水利	111,800	869,804.00	0.63
32	601390	中国中铁	117,500	818,975.00	0.59
33	601939	建设银行	170,900	811,775.00	0.59
34	600020	中原高速	181,861	803,825.62	0.58
35	601018	宁波港	158,500	784,575.00	0.57

36	600006	东风汽车	83,900	744,193.00	0.54
37	600271	航天信息	30,720	731,136.00	0.53
38	600834	申通地铁	55,300	724,983.00	0.52
39	601069	西部黄金	31,200	724,152.00	0.52
40	600887	伊利股份	43,248	720,944.16	0.52
41	601688	华泰证券	36,900	698,148.00	0.50
42	601727	上海电气	92,100	696,276.00	0.50
43	600118	中国卫星	20,488	688,396.80	0.50
44	600547	山东黄金	17,401	677,072.91	0.49
45	600018	上港集团	130,700	666,570.00	0.48
46	600061	国投安信	37,200	662,904.00	0.48
47	600999	招商证券	40,150	662,475.00	0.48
48	601186	中国铁建	64,900	646,404.00	0.47
49	603997	继峰股份	32,400	639,576.00	0.46
50	600048	保利地产	73,647	635,573.61	0.46
51	601618	中国中冶	171,700	633,573.00	0.46
52	600518	康美药业	41,700	633,423.00	0.46
53	600276	恒瑞医药	15,557	623,991.27	0.45
54	600624	复旦复华	48,520	611,352.00	0.44
55	600066	宇通客车	30,736	608,572.80	0.44
56	600340	华夏幸福	24,734	603,014.92	0.44
57	600074	保千里	40,400	602,768.00	0.44
58	600688	上海石化	97,800	596,580.00	0.43
59	600960	渤海活塞	59,140	593,765.60	0.43
60	600007	中国国贸	28,942	584,628.40	0.42
61	600108	亚盛集团	115,600	583,780.00	0.42
62	600526	菲达环保	45,200	582,176.00	0.42
63	600503	华丽家族	63,200	579,544.00	0.42
64	600483	福能股份	51,046	579,372.10	0.42
65	600975	新五丰	63,200	578,280.00	0.42
66	600664	哈药股份	69,452	575,757.08	0.42
67	600270	外运发展	32,700	571,923.00	0.41
68	601788	光大证券	33,000	559,020.00	0.40
69	601901	方正证券	72,700	556,882.00	0.40
70	603789	星光农机	18,800	553,472.00	0.40
71	603969	银龙股份	41,200	549,196.00	0.40
72	600575	皖江物流	126,800	549,044.00	0.40
73	601111	中国国航	81,000	547,560.00	0.40
74	601669	中国电建	95,100	543,021.00	0.39
75	600867	通化东宝	26,100	540,009.00	0.39
76	600490	鹏欣资源	67,200	536,928.00	0.39

77	600487	亨通光电	42,400	533,392.00	0.39
78	600728	佳都科技	54,420	528,962.40	0.38
79	600011	华能国际	70,005	526,437.60	0.38
80	603599	广信股份	28,000	525,560.00	0.38
81	601377	兴业证券	70,900	523,951.00	0.38
82	600979	广安爱众	88,400	521,560.00	0.38
83	601006	大秦铁路	80,334	517,350.96	0.37
84	601099	太平洋	84,250	516,452.50	0.37
85	600283	钱江水利	41,600	516,256.00	0.37
86	600807	天业股份	42,470	514,736.40	0.37
87	600236	桂冠电力	76,020	510,854.40	0.37
88	601607	上海医药	28,262	510,129.10	0.37
89	600893	中航动力	14,700	509,355.00	0.37
90	600392	盛和资源	31,050	508,599.00	0.37
91	600398	海澜之家	44,900	507,370.00	0.37
92	600221	海南航空	160,000	507,200.00	0.37
93	600054	黄山旅游	31,506	506,931.54	0.37
94	600085	同仁堂	17,000	506,430.00	0.37
95	600399	抚顺特钢	78,000	504,660.00	0.36
96	601555	东吴证券	37,500	502,500.00	0.36
97	600188	兖州煤业	45,601	498,874.94	0.36
98	600568	中珠控股	28,400	494,160.00	0.36
99	601336	新华保险	12,100	488,840.00	0.35
100	601801	皖新传媒	41,800	487,806.00	0.35
101	601368	绿城水务	36,800	483,920.00	0.35
102	601339	百隆东方	76,200	483,870.00	0.35
103	600588	用友网络	24,607	481,805.06	0.35
104	600350	山东高速	90,800	481,240.00	0.35
105	600305	恒顺醋业	41,600	479,232.00	0.35
106	603993	洛阳钼业	115,200	478,080.00	0.35
107	600050	中国联通	125,200	477,012.00	0.34
108	603901	永创智能	26,400	474,672.00	0.34
109	600980	北矿科技	16,400	473,960.00	0.34
110	600674	川投能源	56,734	468,622.84	0.34
111	600589	广东榕泰	46,100	467,915.00	0.34
112	601098	中南传媒	25,800	467,238.00	0.34
113	600383	金地集团	45,072	466,945.92	0.34
114	600498	烽火通信	19,200	466,176.00	0.34
115	603328	依顿电子	15,700	463,778.00	0.33
116	600715	文投控股	24,000	460,080.00	0.33
117	600616	金枫酒业	45,000	459,900.00	0.33

118	600988	赤峰黄金	24,600	458,790.00	0.33
119	600109	国金证券	34,000	458,320.00	0.33
120	600987	航民股份	37,350	452,682.00	0.33
121	600850	华东电脑	15,717	450,920.73	0.33
122	600206	有研新材	33,200	446,540.00	0.32
123	601179	中国西电	87,600	444,132.00	0.32
124	600258	首旅酒店	22,200	438,228.00	0.32
125	600489	中金黄金	38,893	437,157.32	0.32
126	601777	力帆股份	37,100	436,667.00	0.32
127	600326	西藏天路	54,300	435,486.00	0.31
128	600100	同方股份	29,000	433,840.00	0.31
129	601588	北辰实业	98,500	420,595.00	0.30
130	600585	海螺水泥	28,850	419,479.00	0.30
131	600703	三安光电	20,900	417,373.00	0.30
132	600220	江苏阳光	90,800	414,048.00	0.30
133	600820	隧道股份	49,200	412,788.00	0.30
134	600690	青岛海尔	46,100	409,368.00	0.30
135	600814	杭州解百	38,500	407,715.00	0.29
136	601579	会稽山	28,700	405,818.00	0.29
137	600741	华域汽车	28,900	404,889.00	0.29
138	600111	北方稀土	29,850	397,303.50	0.29
139	600697	欧亚集团	13,300	394,478.00	0.28
140	600535	天士力	11,009	393,681.84	0.28
141	601899	紫金矿业	116,200	391,594.00	0.28
142	600894	广日股份	29,100	387,903.00	0.28
143	600019	宝钢股份	78,900	386,610.00	0.28
144	601158	重庆水务	59,760	384,256.80	0.28
145	600798	宁波海运	78,000	382,980.00	0.28
146	601515	东风股份	33,700	380,810.00	0.28
147	603968	醋化股份	16,400	380,316.00	0.27
148	600369	西南证券	52,000	377,520.00	0.27
149	600863	内蒙华电	124,250	375,235.00	0.27
150	600537	亿晶光电	48,140	371,159.40	0.27
151	600309	万华化学	21,241	367,469.30	0.27
152	600143	金发科技	56,806	365,830.64	0.26
153	600579	天华院	26,800	365,016.00	0.26
154	600998	九州通	20,600	360,706.00	0.26
155	600337	美克家居	27,700	360,377.00	0.26
156	600372	中航电子	18,400	358,248.00	0.26
157	600377	宁沪高速	42,900	357,786.00	0.26
158	600075	新疆天业	30,400	349,904.00	0.25

159	601933	永辉超市	84,400	348,572.00	0.25
160	601633	长城汽车	40,637	342,976.28	0.25
161	600795	国电电力	116,900	342,517.00	0.25
162	600601	方正科技	79,500	341,850.00	0.25
163	600804	鹏博士	18,700	340,901.00	0.25
164	601678	滨化股份	66,250	337,212.50	0.24
165	600583	海油工程	48,344	334,057.04	0.24
166	600551	时代出版	16,500	329,340.00	0.24
167	600089	特变电工	38,084	324,475.68	0.23
168	600352	浙江龙盛	37,500	323,250.00	0.23
169	601877	正泰电器	17,082	321,995.70	0.23
170	600208	新湖中宝	75,440	319,111.20	0.23
171	603099	长白山	17,800	318,798.00	0.23
172	601928	凤凰传媒	30,200	318,308.00	0.23
173	600566	济川药业	12,361	318,172.14	0.23
174	601888	中国国旅	7,200	316,656.00	0.23
175	600633	浙报传媒	21,000	315,840.00	0.23
176	600332	白云山	12,400	305,536.00	0.22
177	600557	康缘药业	18,696	305,305.68	0.22
178	600626	申达股份	28,550	294,636.00	0.21
179	603555	贵人鸟	11,800	294,174.00	0.21
180	601992	金隅股份	37,700	292,175.00	0.21
181	600273	嘉化能源	32,300	287,793.00	0.21
182	600637	东方明珠	11,711	284,225.97	0.21
183	600031	三一重工	56,300	282,626.00	0.20
184	603028	赛福天	9,600	282,336.00	0.20
185	601168	西部矿业	47,500	281,675.00	0.20
186	600497	驰宏锌锗	28,073	279,887.81	0.20
187	600587	新华医疗	12,034	277,865.06	0.20
188	600406	国电南瑞	20,560	274,887.20	0.20
189	601991	大唐发电	70,100	272,689.00	0.20
190	600751	天海投资	44,500	271,895.00	0.20
191	600578	京能电力	62,700	268,356.00	0.19
192	601117	中国化学	47,300	261,569.00	0.19
193	601369	陕鼓动力	40,250	256,795.00	0.19
194	601231	环旭电子	23,882	255,537.40	0.18
195	601808	中海油服	20,403	247,896.45	0.18
196	600803	新奥股份	20,390	238,155.20	0.17
197	600062	华润双鹤	12,401	225,946.22	0.16
198	600335	国机汽车	19,050	213,550.50	0.15
199	600256	广汇能源	50,172	205,705.20	0.15

200	600779	水井坊	9,900	164,637.00	0.12
-----	--------	-----	-------	------------	------

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	600606	绿地控股	1,286,187.74	0.75
2	601069	西部黄金	638,979.00	0.37
3	603997	继峰股份	613,322.00	0.36
4	600575	皖江物流	579,376.00	0.34
5	600074	保千里	571,434.00	0.33
6	600503	华丽家族	570,260.00	0.33
7	603599	广信股份	568,314.00	0.33
8	600526	菲达环保	563,855.00	0.33
9	603789	星光农机	551,894.92	0.32
10	600979	广安爱众	531,909.57	0.31
11	603969	银龙股份	526,172.50	0.31
12	600975	新五丰	522,604.00	0.30
13	600490	鹏欣资源	518,488.00	0.30
14	600399	抚顺特钢	505,870.00	0.29
15	601368	绿城水务	494,113.00	0.29
16	600980	北矿科技	478,601.70	0.28
17	600568	中珠医疗	476,107.00	0.28
18	603901	永创智能	464,991.00	0.27
19	600715	文投控股	425,886.00	0.25
20	600798	宁波海运	399,143.00	0.23

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	600682	南京新百	1,709,823.06	0.99
2	601288	农业银行	972,979.20	0.56
3	601113	华鼎股份	886,771.82	0.51
4	601718	际华集团	816,108.81	0.47
5	601989	中国重工	740,932.83	0.43
6	600000	浦发银行	568,453.01	0.33
7	600311	荣华实业	474,884.80	0.28

8	600586	金晶科技	467,573.68	0.27
9	600549	厦门钨业	452,388.06	0.26
10	600010	包钢股份	437,809.60	0.25
11	600378	天科股份	418,151.38	0.24
12	600328	兰太实业	406,827.95	0.24
13	600665	天地源	397,270.22	0.23
14	600121	郑州煤电	396,301.20	0.23
15	600966	博汇纸业	354,774.20	0.21
16	600036	招商银行	348,363.92	0.20
17	600150	中国船舶	312,660.73	0.18
18	601988	中国银行	303,696.00	0.18
19	600819	耀皮玻璃	276,445.16	0.16
20	601958	金钼股份	275,155.33	0.16

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	13,539,420.29
卖出股票收入（成交）总额	13,402,422.00

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所有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

公允价值变动总额合计(元)	—
股指期货投资本期收益(元)	—
股指期货投资本期公允价值变动(元)	—

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

公允价值变动总额合计（元）	—
国债期货投资本期收益（元）	—
国债期货投资本期公允价值变动（元）	—

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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“中国人寿”的发行主体中国人寿保险股份有限公司（以下简称“公司”）于2016年6月23日公告称公司收到《中国保险监督管理委员会行政处罚决定书》（保监罚【2016】13号），因公司采取退保金直接冲减退保年度保费收入的方式处理长期险非正常退保业务，违反《保险法》相关规定，被罚款40万元。

中国人寿为本基金跟踪标的指数的成份股。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余9名证券的发行主体本期未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。

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	1,055.23
2	应收证券清算款	—

3	应收股利	—
4	应收利息	736.96
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,792.19

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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限股票。

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(%)
608	70,129.13	37,186,162.00	87.21	5,452,351.00	12.79

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行股份有限公司—富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中国工商银行股份有限公司富国上	36,900,000	86.54

	证综指交易型开放式指数证券		
2	李雯	295,400	0.69
3	吴秀安	281,500	0.66
4	李维嘉	279,100	0.65
5	李佩玉	260,000	0.61
6	李杰	217,800	0.51
7	张玉庆	207,300	0.49
8	孟君	191,500	0.45
9	华融证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	168,260	0.39
10	李桂平	163,359	0.38

8.3 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	—	—

8.4 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	0
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(2011年01月30日)基金份额总额	320,363,407.00
报告期期初基金份额总额	44,638,513.00
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	2,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	42,638,513.00

§ 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

本报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

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。

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

2016年6月，针对上海证监局向公司出具的《关于对富国基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，以及对相关负责人的警示，公司高度重视，认真落实整改要求，加强制度和风控措施，着力进一步加强公司内部控制和风险管理能力。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
银河证券	2	26,678,542.43	100.00	118,836.00	100.00	—	—	—	—	56,178.79	100.00	—

注：我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。本期内本基金租用的券商交易单元无变更。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司旗下基金 2015 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	公司官网	2016 年 01 月 04 日
2	富国基金管理有限公司关于停止办理电话交易业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 03 月 05 日
3	富国基金管理有限公司关于旗下基金 2015 年年度报告的更正公告的备案	中国证券报、上海证券报	2016 年 04 月 12 日
4	富国基金管理有限公司关于上证综指交易型开放式指数证券投资基金调整成份股的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 06 月 02 日
5	富国基金管理有限公司关于开展京东官方旗舰店基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 06 月 30 日

§ 11 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立上证综指交易型开放式指数证券投资基金的文件 2、上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金合同 3、上证综指交易型开放式指数证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。 咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费） 公司网址： http://www.fullgoal.com.cn

富国基金管理有限公司的文件 5、上证综指交易型开放式指数证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告		
---	--	--