

富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金  
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	境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5	信息披露方式.....	6
2.6	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.....	7
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	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9	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.....	12
§5	托管人报告.....	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	13
§6	半年度财务报表(未经审计).....	13
6.1	资产负债表.....	13
6.2	利润表.....	14
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	15
6.4	报表附注.....	16
§7	投资组合报告.....	33
7.1	期末基金资产组合情况.....	33
7.2	期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布.....	34
7.3	期末按行业分类的权益投资组合.....	34
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	34
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动.....	44
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	46
7.7	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.....	46

7.8	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	.46
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	.46
7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	.....46
7.11	投资组合报告附注	.....47
§8	基金份额持有人信息	.....48
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	.....48
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	.....48
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	.....48
§9	开放式基金份额变动	.....48
§10	重大事件揭示	.....49
10.1	基金份额持有人大会决议	.....49
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	.....49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	.....49
10.4	基金投资策略的改变	.....49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	.....49
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	.....49
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	.....50
10.8	其他重大事件	.....55
§11	备查文件目录	.....55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金
基金简称	富国中国中小盘混合（QDII）
基金主代码	100061
交易代码	前端交易代码：100061 后端交易代码：000162
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年09月04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	910,336,501.30 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于香港市场中的中国概念中小盘股票，通过精选个股和风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	通过积极主动的投资，精选香港市场中具有中国概念的优质股票进行投资，分享中国经济快速成长的成果。中小盘股票成长空间大，且往往存在估值洼地，能够为投资者带来超额收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国自由投资中小盘股票指数(MSCI China Free SMID Index)收益率×80%+香港三个月期银行同业拆借利率(Hong Kong 3-Month Interbank Offer Rate)×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

### 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	北京市西城区复兴门内大

	号上海国金中心二期 16-17 层	街 55 号
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 层	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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文	-	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		-	-
办公地址		-	-
邮政编码		-	-

#### 2.5 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
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

#### 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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

### § 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	-157,121,874.24
本期利润	-131,316,970.98
加权平均基金份额本期利润	-0.1739
本期加权平均净值利润率	-10.95%
本期基金份额净值增长率	-8.73%
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	171,100,605.14
期末可供分配基金份额利润	0.1880
期末基金资产净值	1,503,632,138.45
期末基金份额净值	1.652
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	65.20%

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	1.04%	0.82%	-0.02%	1.00%	1.06%	-0.18%
过去三个月	2.10%	0.74%	-0.34%	0.77%	2.44%	-0.03%
过去六个月	-8.73%	1.21%	-6.48%	1.05%	-2.25%	0.16%
过去一年	-18.90%	1.73%	-14.51%	1.54%	-4.39%	0.19%
过去三年	27.27%	1.31%	8.66%	1.13%	18.61%	0.18%
自基金合同生效日起至今	65.20%	1.26%	23.39%	1.10%	41.81%	0.16%

注：本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国自由投资中小盘股票指数(MSCI China Free SMID Index)收益率×80%+香港三个月期银行同业拆借利率（Hong Kong

3-Month Interbank Offer Rate) × 20%。

MSCI 中国自由投资中小盘股票指数，是由 MSCI 编制的反映在香港上市的中国内地中小企业整体状况的指数。

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 (benchmark<sub>t</sub>) 按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = [\text{MSCI 中国自由投资中小盘股票指数}_t / (\text{MSCI 中国自由投资中小盘股票指数}_{t-1}) - 1] * 80\% + [\text{香港三个月期银行同业拆借利率} / 365] * 20\%;$$

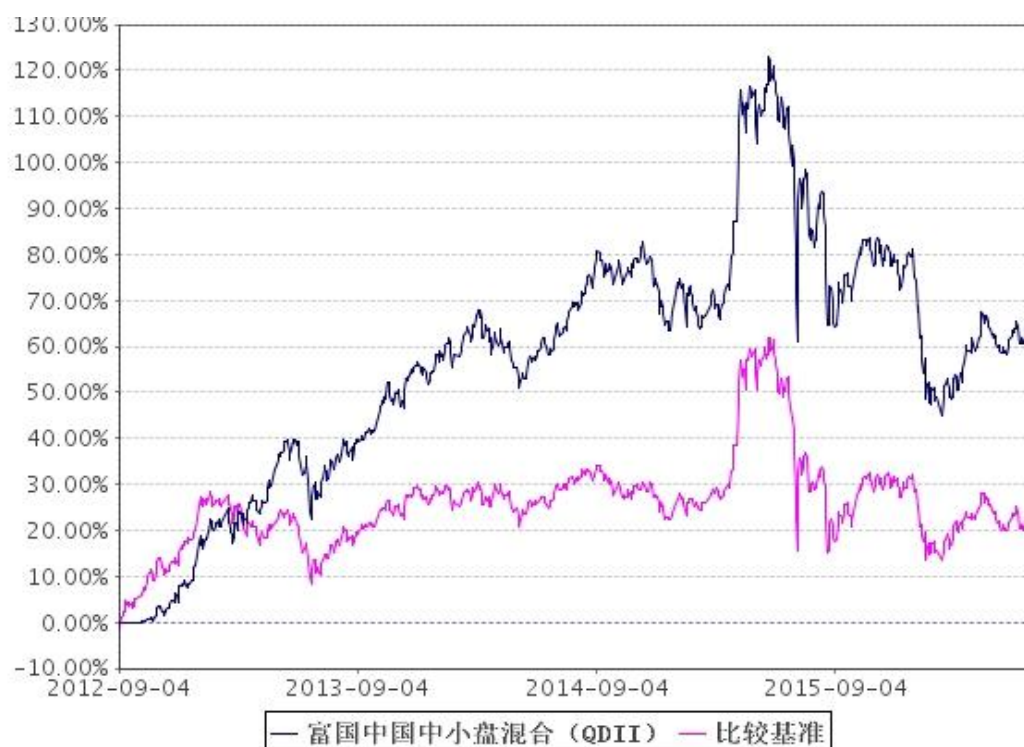
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日；

期间  $T$  日收益率 (benchmark<sub>T</sub>) 按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$  表示  $t$  日至  $T$  日的  $(1 + \text{benchmark}_t)$  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 2016 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2012 年 9 月 4 日成立，建仓期 6 个月，从 2012 年 9 月 4 日起至 2013 年 3 月 3 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		
宁君	本基金前任基金经理助理	2014-04-23	2016-06-06	6年	硕士，2011年8月至2014年4月任富国基金管理有限公司助理QDII研究员；2014年4月至2016年6月任富国全球顶级消费品混合型证券投资基金基金经理助理和富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金基金经理助理。具有基金从业资格。
张峰	本基金基金经理兼任海外权益投资部总经理、富国全球顶级消费品混合型证券投资基金、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2012-09-04	—	14年	硕士，曾任摩根史丹利研究部助理，里昂证券股票分析员，摩根大通执行董事，美林证券高级董事；自2009年7月至2011年4月任富国基金管理有限公司周期性行业研究负责人，2011年4月至2012年12月任富国全球债券证券投资基金基金经理，自2011年7月起任富国全球顶级消费品混合型证券投资基金基金经理，自2012年9月起任富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金基金经理，自2015年6月起任富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年2月起任兼任海外权益投资部总经理。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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中国中小盘(香港上市)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、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，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 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。

### 4.4.2 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。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

我们对于市场的看法是今年一到三季度震荡筑底。四季度开始决定性的从熊市底部进入上升通道。

上半年开年不利，市场一，二月份回调比较大。然后三，四月回稳。5月又有回调。6,7月份反弹。可以看出，市场处于震荡区间。但底部逐渐抬高。上半年中小盘股票跑输大盘。我们认为这是典型的熊市底部特征，即大盘股企稳，中小盘股在市场筑底以后，才会开始有所表现。

#### 4.5.2 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 1.652 元,份额累计净值为 1.652 元;本报告期内,本基金份额净值增长率为-8.73%,同期业绩比较基准收益率为-6.48%。

#### 4.6 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,估计三季度或四季度初还会有震荡。但鉴于中国经济已经出现明显企稳迹象,比如地产和汽车销售明显好转,融资成本继续处于低位。美国,欧洲和日本利率维持低位,美联储即使加息也会非常缓慢,这些都有利新兴市场和中国经济今年四季度和明年增长加快。

我们仍然会一如既往地关注估值非常低廉的中小盘股票。力争在市场好转的时候,为投资人带来比较好的回报。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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,本基金托管人在对富国中国中小盘(香港上市)混合型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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金的管理人一

—富国基金管理有限公司在富国中国中小盘（香港上市）混合型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，富国中国中小盘（香港上市）混合型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富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金 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：富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金

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)
<b>资 产：</b>		
银行存款	396,261,333.92	297,599,146.86
结算备付金	7,418,343.35	823,135.61
存出保证金	2,879,244.93	—
交易性金融资产	1,097,017,944.18	1,281,421,113.92
其中：股票投资	1,094,609,159.35	1,274,109,238.17
基金投资	2,408,784.83	7,311,875.75
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	5,041.19	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	10,314,271.50	2,729,110.68
应收利息	70,013.04	39,654.41
应收股利	11,343,006.17	175,067.58
应收申购款	2,848,887.24	2,723,575.32
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	1,528,158,085.52	1,585,510,804.38

负债和所有者权益	本期末 (2016年06月30日)	上年度末 (2015年12月31日)
<b>负 债:</b>		
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	17,042,153.08	13,473,646.77
应付赎回款	5,047,294.86	7,960,918.67
应付管理人报酬	1,921,384.30	2,080,231.35
应付托管费	360,259.56	390,043.40
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	56,266.50	534,853.01
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	98,588.77	170,555.17
负债合计	24,525,947.07	24,610,248.37
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	910,336,501.30	862,261,661.58
未分配利润	593,295,637.15	698,638,894.43
所有者权益合计	1,503,632,138.45	1,560,900,556.01
负债和所有者权益总计	1,528,158,085.52	1,585,510,804.38

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.652 元，基金份额总额 910,336,501.30 份。

## 6.2 利润表

会计主体：富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金

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)
<b>一、收入</b>	-114,542,655.01	76,133,885.79
1. 利息收入	652,881.64	514,082.58
其中：存款利息收入	652,881.64	514,082.58
债券利息收入	—	—
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）	-144,324,437.46	101,410,681.64

其中：股票投资收益	-163,044,701.56	84,415,955.69
基金投资收益	456,378.10	472,741.94
债券投资收益	—	—
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	—	10,822.04
股利收益	18,263,886.00	16,511,161.97
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	25,804,903.26	-18,684,020.85
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	2,575,691.20	-8,216,344.35
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	748,306.35	1,109,486.77
<b>减：二、费用</b>	<b>16,774,315.97</b>	<b>17,667,245.30</b>
1. 管理人报酬	9,547,677.91	8,850,874.19
2. 托管费	1,790,189.60	1,659,538.93
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	5,264,169.21	7,018,714.29
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	172,279.25	138,117.89
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-131,316,970.98</b>	<b>58,466,640.49</b>
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-131,316,970.98</b>	<b>58,466,640.49</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金

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）	862,261,661.58	698,638,894.43	1,560,900,556.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-131,316,970.98	-131,316,970.98
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）	48,074,839.72	25,973,713.70	74,048,553.42
其中：1. 基金申购款	416,613,736.39	255,935,807.80	672,549,544.19
2. 基金赎回款	-368,538,896.67	-229,962,094.10	-598,500,990.77
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)	910,336,501.30	593,295,637.15	1,503,632,138.45
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)	417,875,388.23	289,692,699.38	707,568,087.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	58,466,640.49	58,466,640.49
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)	696,856,397.12	807,446,154.28	1,504,302,551.40
其中: 1. 基金申购款	1,144,141,822.53	1,245,585,195.59	2,389,727,018.12
2. 基金赎回款	-447,285,425.41	-438,139,041.31	-885,424,466.72
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)	1,114,731,785.35	1,155,605,494.15	2,270,337,279.50

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

富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金(原名富国中国中小盘(香港上市)股票型证券投资基金)(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”)证监许可[2012]955号《关于核准富国中国中小盘(香港上市)股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2012年9月4日正式生效,首次设立募集规模为249,999,292.07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和注册登记机构为富国基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司,境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司(The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited)。

根据自2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定,经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,自2015年8月4日起本基金更名为富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金。

本基金的投资范围包括但不限于在已与中国证监会签署双边监管合作谅解



备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票，在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含 ETF）、债券、货币市场工具、金融衍生品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关要求）。

本基金为混合型基金，投资于股票及其他权益类资产的比例不低于基金资产的 60%。现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具市值占基金资产的比例不高于 40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金将以不低于股票资产的 80%投资于在香港证券市场交易的中小盘中国概念股。

本基金的业绩基准为：MSCI 中国自由投资中小盘股票指数 (MSCI China Free SMID Index) 收益率×80%+香港三个月期银行同业拆借利率 (Hong Kong 3-Month Interbank Offer Rate) ×20%。

#### **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**

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

#### **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**

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。

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》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局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》、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》及其他境内外相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税；

(2) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；

(3) 基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 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	396,261,333.92
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	396,261,333.92

注：

本基金外币存款余额构成列示如下

币种	2016年6月30日		
	外币金额	折算汇率	折合人民币
港币	39,435,711.90	0.8547	33,704,519.89
美元	5,055,017.04	6.6312	33,520,828.99
合计			67,225,348.88

##### 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	1,133,542,524.63	1,094,609,159.35	-38,933,365.28
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	—	—	—
基金	2,176,587.38	2,408,784.83	232,197.45
其他	—	—	—
合计	1,135,719,112.01	1,097,017,944.18	-38,701,167.83

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

金额单位：人民币元

项目	本期末（2016年06月30日）
----	------------------

	名义金额	公允价值		备注(成本)
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	—	—	—	—
其他衍生工具	5,041.19	5,041.19	—	—
合计	5,041.19	5,041.19	—	—

#### 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	70,013.04
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	—
合计	70,013.04

#### 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	56,266.50
银行间市场应付交易费用	—
合计	56,266.50

#### 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	19,027.47
信息披露费	29,835.26
审计费	49,726.04
合计	98,588.77

#### 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	862,261,661.58	862,261,661.58
本期申购	416,613,736.39	416,613,736.39
本期赎回（以“-”号填列）	-368,538,896.67	-368,538,896.67
本期末	910,336,501.30	910,336,501.30

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	349,093,869.79	349,545,024.64	698,638,894.43
本期利润	-157,121,874.24	25,804,903.26	-131,316,970.98
本期基金份额交易产生的变动数	-20,871,390.39	46,845,104.09	25,973,713.70
其中：基金申购款	88,593,287.86	167,342,519.94	255,935,807.80
基金赎回款	-109,464,678.25	-120,497,415.85	-229,962,094.10
本期已分配利润	—	—	—
本期末	171,100,605.16	422,195,031.99	593,295,637.15

#### 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	639,018.02
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	13,863.62
其他	—
合计	652,881.64

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2016年01月01日至2016年06月30日）
卖出股票成交总额	1,560,124,931.09
减：卖出股票成本总额	1,723,169,632.65
买卖股票差价收入	-163,044,701.56

#### 6.4.7.13 基金投资收益

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/赎回基金成交总额	29,075,562.61
减：卖出/赎回基金成本总额	28,619,184.51
基金投资收益	456,378.10

#### 6.4.7.14 债券投资收益

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.15 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期末无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.16 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.17 衍生工具收益

##### 6.4.7.17.1 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。

##### 6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期末无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.18 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	18,107,605.58
基金投资产生的股利收益	156,280.42
合计	18,263,886.00

#### 6.4.7.19 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	25,799,862.07
股票投资	25,666,323.39
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	133,538.68
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	5,041.19
权证投资	5,041.19
3. 其他	—
合计	25,804,903.26

#### 6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2016年01月01日至2016年06月30日）
基金赎回费收入	748,306.35
合计	748,306.35

#### 6.4.7.21 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	5,264,169.21
银行间市场交易费用	—
合计	5,264,169.21

#### 6.4.7.22 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	49,726.04
信息披露费	29,835.26
银行汇划费	220.00
其他	92,497.95
合计	172,279.25

#### 6.4.7.23 分部报告

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 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，本基金无需要披露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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
香港上海汇丰银行有限公司（“汇丰银行”）	基金境外托管行
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
海通国际证券集团有限公司	基金管理人的股东控制的子公司
申万宏源（香港）有限公司	基金管理人的股东控制的子公司
工银国际控股有限公司（“工银国际”）	基金托管人的子公司

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

##### 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

金额单位：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)	
	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(%)
海通国际证券集团有限公司	285,437,398.25	9.35	47,630,823.75	0.70
申万宏源（香港）有限公司	61,635,414.16	2.02	340,871,748.45	9.50
工银国际	97,657,812.28	3.20	—	—

###### 6.4.10.1.2 权证交易

金额单位：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)	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
海通国际证券集团有限公司	—	—	19,293.08	47.94

###### 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 基金交易

金额单位：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）	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
申万宏源（香港）有限公司	—	—	2,867,387.96	3.8900
海通国际证券集团有限公司	4,612,251.03	8.7600	—	—
工银国际	716,595.48	1.3600	—	—

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2016年01月01日至2016年06月30日）			
	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（%）
海通国际证券集团有限公司	294,094.47	12.22	—	—
申万宏源（香港）有限公司	51,778.87	2.15	—	—
工银国际	108,380.12	4.50	—	—
关联方名称	上年度可比期间（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（%）
海通国际证券集团有限公司	41,829.36	1.11	—	—
申万宏源（香港）有限公司	339,322.24	8.98	—	—
工银国际	—	—	—	—

### 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	9,547,677.91	8,850,874.19
其中：支付销售机构的客户维护费	2,357,152.92	3,612,713.40

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.60%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 1.60\% / \text{当年天数}$

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

基金的管理费每日计算，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	1,790,189.60	1,659,538.93

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.30%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计算，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(%)
申万宏源	—	—	27,096,984.69	3.14

#### 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
香港上海汇丰银行有限公司	67,225,151.00	—	46,625,972.40	—
中国工商银行股份有限公司	329,036,182.92	639,018.02	639,909,246.13	514,082.58

#### 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：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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同责任，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。本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不超过基金净值的 10%，持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品时，要求所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级，并且任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

### **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。

本基金持有的法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。

### **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	396,261,333.92	—	—	—	—	—	396,261,333.92
结算备付金	7,418,343.35	—	—	—	—	—	7,418,343.35
存出保证金	2,879,244.93	—	—	—	—	—	2,879,244.93
交易性金融资产	—	—	—	—	—	1,097,022,985.37	1,097,022,985.37
应收证券清算款	—	—	—	—	—	10,314,271.50	10,314,271.50
应收利息	—	—	—	—	—	70,013.04	70,013.04
应收股利	—	—	—	—	—	11,343,006.17	11,343,006.17
应收申购款	—	—	—	—	—	2,848,887.24	2,848,887.24
资产总计	406,558,922.20	—	—	—	—	1,121,599,163.32	1,528,158,085.52
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	5,617,344.23	5,617,344.23
应付赎回款	—	—	—	—	—	5,047,294.86	5,047,294.86
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	1,921,384.30	1,921,384.30
应付托管费	—	—	—	—	—	360,259.56	360,259.56
应付交易费用	—	—	—	—	—	56,266.50	56,266.50
其他负债	—	—	—	—	—	98,588.77	98,588.77
负债总计	—	—	—	—	—	13,101,138.22	13,101,138.22
利率敏感度缺口	406,558,922.20	—	—	—	—	1,108,498,025.10	1,515,056,947.30
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	297,599,146.86	—	—	—	—	—	297,599,146.86
结算备付金	823,135.61	—	—	—	—	—	823,135.61
交易性金融资产	—	—	—	—	—	1,281,421,113.92	1,281,421,113.92
应收利息	—	—	—	—	—	39,654.41	39,654.41
应收股利	—	—	—	—	—	175,067.58	175,067.58
应收申购款	1,137,846.09	—	—	—	—	1,585,729.23	2,723,575.32
应收证券清算款	—	—	—	—	—	2,729,110.68	2,729,110.68
资产总计	299,560,128.56	—	—	—	—	1,285,950,675.82	1,585,510,804.38
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	13,473,646.77	13,473,646.77
应付赎回款	—	—	—	—	—	7,960,918.67	7,960,918.67
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	2,080,231.35	2,080,231.35
应付托管费	—	—	—	—	—	390,043.40	390,043.40
应付交易费用	—	—	—	—	—	534,853.01	534,853.01
其他负债	—	—	—	—	—	170,555.17	170,555.17
负债总计	—	—	—	—	—	24,610,248.37	24,610,248.37
利率敏感度缺口	299,560,128.56	—	—	—	—	1,261,340,427.45	1,560,900,556.01

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本期末未持有人民币计价债券资产，因此境内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

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末（2016年06月30日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
银行存款	33,520,828.99	33,704,519.89	0.00	—	67,225,348.88
交易性金融资产	26,879,710.91	1,070,138,233.27	0.00	—	1,097,017,944.18
应收股利	—	11,343,006.17	0.00	—	11,343,006.17
证券清算款	—	10,314,271.50	0.00	—	10,314,271.50
衍生金融资产	—	5,041.19	—	—	5,041.19
资产合计	60,400,539.90	1,125,505,072.02	—	—	1,185,905,611.92
以外币计价的负债					
证券清算款	5,617,344.23	—	—	—	5,617,344.23
负债合计	5,617,344.23	—	—	—	5,617,344.23
资产负债表外汇风险敞口净额	54,783,195.67	1,125,505,072.02	—	—	1,180,288,267.69
项目	上年度末（2015年12月31日）				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	欧元折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
银行存款	35,009,905.89	83,033,191.22	—	—	118,043,097.11
交易性金融资产	44,860,861.44	1,236,560,252.48	—	—	1,281,421,113.92
应收股利	—	175,067.58	—	—	175,067.58
应收利息	—	—	—	—	—
应收证券清算款	—	—	—	—	—
资产合计	79,870,767.33	1,319,768,511.28	—	—	1,399,639,278.61
以外币计价的负债					
应付证券清算款	2,558,491.91	10,915,154.86	—	—	13,473,646.77
负债合计	2,558,491.91	10,915,154.86	—	—	13,473,646.77

资产负债表外汇风险敞口净额	77,312,275.42	1,308,853,356.42	—	—	1,386,165,631.84
---------------	---------------	------------------	---	---	------------------

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化 1%，其他变量不变； (2) 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
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)
	美元相对人民币升值 1%	547,831.96	458,058.27
	美元相对人民币贬值 1%	-547,831.96	-458,058.27
	港币相对人民币升值 1%	11,255,050.72	6,406,101.80
	港币相对人民币贬值 1%	-11,255,050.72	-6,406,101.80

#### 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。本基金的投资范围包括但不限于在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票，在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含 ETF）、债券、货币市场工具、金融衍生品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关要求）。本基金为股票型基金，投资于股票及其他权益类资产的比例不低于基金资产的 60%。现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具市值占基金资产的比例不高于 40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于 2015 年 6 月 30 日，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	公允价值	占基金资产

		值比例 (%)		净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,094,609,159.35	72.80	1,274,109,238.17	81.63
交易性金融资产—基金投资	2,408,784.83	0.16	7,311,875.75	0.47
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	5,041.19	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,097,022,985.37	72.96	1,281,421,113.92	82.09

#### 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%	17,916,450.36	17,225,047.67
	2. 业绩比较基准减少 1%	-17,916,450.36	-17,225,047.67

#### 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1,097,022,985.37元，属于第二层次的余额为人民币0.00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	1,094,609,159.35	71.63
	其中:普通股	1,052,002,483.84	68.84
	存托凭证	—	—
	房地产信托凭证	42,606,675.51	2.79
2	基金投资	2,408,784.83	0.16
3	固定收益投资	—	—
	其中:债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	5,041.19	—
	其中:远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	5,041.19	—
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	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	403,679,677.27	26.42
8	其他各项资产	27,455,422.88	1.80
9	合计	1,528,158,085.52	100.00

注:截止6月30日,本基金通过沪港通渠道持仓的港股市值为人民币119,294,461.40元,占净值比例是7.93%。

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	1,067,729,448.44	71.01
美国	26,879,710.91	1.79
合计	1,094,609,159.35	72.80

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
工业	311,064,372.13	20.69
金融	258,887,957.60	17.22
非日常生活消费品	221,014,962.81	14.70
信息技术	136,772,618.08	9.10
医疗保健	72,908,625.19	4.85
原材料	38,673,694.68	2.57
公用事业	33,732,474.52	2.24
日常消费品	9,160,523.99	0.61
电信业务	7,240,764.25	0.48
能源	5,153,166.10	0.34
合计	1,094,609,159.35	72.80

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在证券 市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允 价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	TECHNOVATOR INTERNATIONAL LIMITED	科诺威德	1206 HK	香港交易所	中国香港	13876000	46,726,039.62	3.11
2	DAWN RAYS PHARMACEUTICAL HOLDINGS	东瑞制药	2348 HK	香港交易所	中国香港	8356000	42,278,405.32	2.81
3	BEIJING URBAN CONSTRUCTION -H	城建集团	1599 HK	香港交易所	中国香港	10699000	38,405,280.19	2.55
4	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING	香港交易所	388 HK	香港交易所	中国香港	221388	35,496,486.74	2.36

	CLEAR							
5	DONGJIANG ENVIRONMENTAL-H	东江环保	895 HK	香港交易所	中国香港	3084825	35,012,818.04	2.33
6	GUANGDONG YUEYUN TRANSPORTAT	南粤物流	3399 HK	香港交易所	中国香港	9292000	34,545,932.33	2.30
7	Concord New Energy Group Ltd	协合新能源	182 HK	香港交易所	中国香港	93130000	34,226,029.35	2.28
8	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 HK	香港交易所	中国香港	1446000	30,958,113.14	2.06
9	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	耐世特	1316 HK	香港交易所	中国香港	4646000	28,033,825.55	1.86
10	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL-H	中国国际金融有限公司	3908 HK	香港交易所	中国香港	2539200	25,564,697.60	1.70
11	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	福耀玻璃	3606 HK	香港交易所	中国香港	1626400	24,965,033.77	1.66
12	YUNNAN WATER INVESTMENT -H	云南水务投资股份有限公司	6839 HK	香港交易所	中国香港	6827000	23,631,069.96	1.57
13	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港交易所	中国香港	155100	23,343,695.72	1.55
14	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际	354 HK	香港交易所	中国香港	7966000	20,561,069.68	1.37
15	HOPEFLUENT GROUP HLDS LTD	合富辉煌	733 HK	香港交易所	中国香港	11180000	19,683,733.84	1.31
16	HNA INFRASTRUCTURE COM	海航基础产业集团有限公司	357 HK	香港交易所	中国香港	2735000	19,588,438.13	1.30
17	POLY CULTURE GROUP CORP-H	保利文化	3636 HK	香港交易所	中国香港	1214500	18,621,661.07	1.24
18	QINGDAO PORT INTERNATIONAL-H	青岛机场	6198 HK	香港交易所	中国香港	6143000	18,428,334.71	1.23
19	XIAMEN INTERNATIONAL PORT-H	厦门港务	3378 HK	香港交易所	中国香港	14136000	18,364,054.98	1.22
20	CHINA	中国光大控股	165 HK	香港交易所	中国香港	1352000	17,217,156.22	1.15

	EVERBRIGHT LTD	(香港)						
21	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	中国建筑国际	3311 HK	香港交易所	中国香港	1918000	16,753,207.15	1.11
22	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	浙江沪杭甬	576 HK	香港交易所	中国香港	2676000	16,672,936.55	1.11
23	AIA GROUP LTD	友邦保险	1299 HK	香港交易所	中国香港	415800	16,471,482.28	1.10
24	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	海螺创业	586 HK	香港交易所	中国香港	1245500	16,350,589.21	1.09
25	LINK REIT	领展房产基金	823 HK	香港交易所	中国香港	356500	16,087,624.34	1.07
26	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技	2382 HK	香港交易所	中国香港	565000	13,110,424.14	0.87
27	FORTUNE REIT	置富产业信托	778 HK	香港交易所	中国香港	1615000	12,767,701.46	0.85
28	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	旭辉控股集团	884 HK	香港交易所	中国香港	7258000	11,786,070.23	0.78
29	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	宁沪高速	177 HK	香港交易所	中国香港	1188000	10,945,451.01	0.73
30	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	重庆农村商业银行	3618 HK	香港交易所	中国香港	3255000	10,905,247.33	0.73
31	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国海外发展	688 HK	香港交易所	中国香港	512000	10,720,980.48	0.71
32	COSCO INTERNATIONAL HO	中远国际控股	517 HK	香港交易所	中国香港	3262000	10,705,664.79	0.71
33	SINOSOFT TECHNOLOGY GROUP LT	中国擎天软件	1297 HK	香港交易所	中国香港	2816000	10,517,500.65	0.70
34	CHINA MERCHANTS BANK-H	招商银行	3968 HK	香港交易所	中国香港	693500	10,277,654.60	0.68
35	SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	首钢资源	639 HK	香港交易所	中国香港	8212000	9,685,599.06	0.64
36	CHINA VAST INDUSTRIAL URBAN	中国宏泰发展	6166 HK	香港交易所	中国香港	3519000	9,052,827.03	0.60
37	WONDERFUL SKY	皓天财经集团	1260 HK	香港交易所	中国香港	5170000	8,748,914.92	0.58

	FINANCIAL GROUP							
38	LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP	丽珠医药	1513 HK	香港交易所	中国香港	285250	8,496,242.42	0.57
39	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	利福国际	1212 HK	香港交易所	中国香港	731000	8,121,929.02	0.54
40	EMPEROR ENTERTAINMENT HOTEL	英皇娱乐酒店	296 HK	香港交易所	中国香港	4985000	7,881,980.41	0.52
41	NEW ORIENTAL EDUCATION-SPADR	新东方	EDU US	美国交易所	美国	28100	7,803,781.83	0.52
42	BYD CO LTD-H	比亚迪股份	1211 HK	香港交易所	中国香港	191000	7,582,589.51	0.50
43	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	瑞声科技	2018 HK	香港交易所	中国香港	131500	7,400,822.56	0.49
44	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	阳光房地产基金	435 HK	香港交易所	中国香港	1893000	7,151,075.17	0.48
45	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	申洲国际	2313 HK	香港交易所	中国香港	216000	6,913,596.57	0.46
46	CHINA SANJIANG FINE CHEMICAL	中国三江化工	2198 HK	香港交易所	中国香港	7048000	6,626,085.58	0.44
47	CHINA MOBILE LTD	中国移动	941 HK	香港交易所	中国香港	80000	6,061,319.65	0.40
48	ANHUI EXPRESSWAY CO LTD-H	皖通高速	995 HK	香港交易所	中国香港	1156000	6,046,550.94	0.40
49	VALUE PARTNERS GROUP LTD	惠理集团	806 HK	香港交易所	中国香港	956000	5,809,328.74	0.39
50	QINGLING MOTORS CO LTD-H	庆铃汽车	1122 HK	香港交易所	中国香港	2818000	5,780,304.14	0.38
51	CONSUN PHARMACEUTICAL GROUP	康臣药业	1681 HK	香港交易所	中国香港	1695000	5,736,715.97	0.38
52	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华控股	1999 HK	香港交易所	中国香港	598800	5,711,424.58	0.38
53	WHEELOCK & CO	会德丰	20 HK	香港交易所	中国香港	183000	5,669,667.12	0.38

	LTD							
54	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建材	3323 HK	香港交易所	中国香港	1900000	5,488,690.74	0.37
55	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广州汽车	2238 HK	香港交易所	中国香港	676000	5,344,251.51	0.36
56	WEIBO CORP-SPON ADR	新浪微博	WB US	美国交易所	美国	28000	5,274,986.98	0.35
57	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	碧桂园	2007 HK	香港交易所	中国香港	1880000	5,238,101.50	0.35
58	EIJING JINGNENG CLEAN ENE-H	京能清洁能源	579 HK	香港交易所	中国香港	2346000	5,052,740.67	0.34
59	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	东风汽车	489 HK	香港交易所	中国香港	712000	4,916,882.32	0.33
60	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行(香港)	3988 HK	香港交易所	中国香港	1800000	4,753,674.54	0.32
61	GLENCORE PLC	嘉能可	805 HK	香港交易所	中国香港	350400	4,611,936.07	0.31
62	SITC INTERNATIONA L HOLDINGS	海丰国际	1308 HK	香港交易所	中国香港	1313000	4,556,057.74	0.30
63	CHINA RESOURCES LAND LTD	华润置地	1109 HK	香港交易所	中国香港	292000	4,517,101.88	0.30
64	WEICHAH POWER CO LTD-H	潍柴动力	2338 HK	香港交易所	中国香港	654000	4,438,096.19	0.30
65	METALLURGICA L CORP OF CHIN-H	中国中冶(香港)	1618 HK	香港交易所	中国香港	2100000	4,253,692.59	0.28
66	L&apos;OCCIT ANE INTERNATIONA L SA	欧舒丹	973 HK	香港交易所	中国香港	301250	4,078,314.31	0.27
67	OURGAME INTERNATIONA L HOLDIN	联众	6899 HK	香港交易所	中国香港	1350000	4,003,701.62	0.27
68	PROSPERITY REIT	泓富产业信托	808 HK	香港交易所	中国香港	1412000	3,837,605.05	0.26
69	XINHUA WINSHARE	中科光电	811 HK	香港交易所	中国香港	522000	3,716,327.37	0.25

	PUBLISHING-H							
70	SHANGHAI JINJIANG INTL HO-H	锦江酒店	2006 HK	香港交易所	中国香港	1700000	3,675,935.67	0.24
71	YUEXIU TRANSPORT INFRASTRUCT	越秀交通基建	1052 HK	香港交易所	中国香港	862000	3,668,893.19	0.24
72	WH GROUP LTD	万洲国际	288 HK	香港交易所	中国香港	700000	3,637,475.52	0.24
73	BAOZUN INC-SPN ADR	宝尊电子商务有限公司	BZUN US	美国交易所	美国	84420	3,633,140.32	0.24
74	HARBIN BANK CO LTD-H	哈尔滨银行（香港）	6138 HK	香港交易所	中国香港	2069000	3,501,258.22	0.23
75	CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	中国制药	1093 HK	香港交易所	中国香港	580000	3,420,389.34	0.23
76	CHINA DONGXIANG GROUP	中国动向	3818 HK	香港交易所	中国香港	2887000	3,380,382.24	0.22
77	BANK OF CHONGQING CO LTD-H	重庆银行	1963 HK	香港交易所	中国香港	646500	3,293,163.16	0.22
78	BEIJINGWEST INDUSTRIES INTER	京西国际	2339 HK	香港交易所	中国香港	21724000	3,137,797.83	0.21
79	SANDS CHINA LTD	金沙中国	1928 HK	香港交易所	中国香港	140400	3,113,887.59	0.21
80	SINOTRANS LIMITED-H	中国外运	598 HK	香港交易所	中国香港	1050000	3,078,094.01	0.20
81	YUZHOU PROPERTIES CO	禹洲地产	1628 HK	香港交易所	中国香港	1621000	2,992,507.35	0.20
82	WELLING HOLDING LTD	威灵控股	382 HK	香港交易所	中国香港	2414000	2,950,337.93	0.20
83	BHP BILLITON LTD-SPON ADR	必和必拓公司	BHP US	美国交易所	美国	15200	2,878,683.49	0.19
84	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码	751 HK	香港交易所	中国香港	516000	2,796,001.62	0.19
85	CHAMPION REIT	冠君产业信托	2778 HK	香港交易所	中国香港	738000	2,762,669.49	0.18
86	SHANGHAI HAOHAI BIOLOGICAL-H	昊海生物科技	6826 HK	香港交易所	中国香港	88900	2,731,486.86	0.18
87	TEXWINCA HOLDINGS LTD	德永佳集团	321 HK	香港交易所	中国香港	554000	2,717,816.41	0.18

88	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	理文造纸	2314 HK	香港交易所	中国香港	540000	2,653,750.35	0.18
89	CHINA BIOLOGIC PRODUCTS INC	中国生物制品股份有限公司	CBPO US	美国交易所	美国	3700	2,608,607.98	0.17
90	CENTRAL CHINA SECURITIES C-H	中州证券	1375 HK	香港交易所	中国香港	897000	2,552,907.84	0.17
91	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	868 HK	香港交易所	中国香港	512000	2,494,268.93	0.17
92	SHANDONG LUOXIN PHARMACY-H	罗欣药业	8058 HK	香港交易所	中国香港	240000	2,404,015.78	0.16
93	TK GROUP HOLDINGS LTD	东江集团控股	2283 HK	香港交易所	中国香港	1412000	2,377,384.26	0.16
94	BAIC MOTOR CORP LTD-H	北京汽车	1958 HK	香港交易所	中国香港	481500	2,242,803.65	0.15
95	BAIDU INC - SPON ADR	百度	BIDU US	美国交易所	美国	2010	2,201,236.79	0.15
96	China Construction BANK	建设银行	939 HK	香港交易所	中国香港	500000	2,187,955.20	0.15
97	WYNN MACAU LTD	永利澳门	1128 HK	香港交易所	中国香港	219200	2,087,008.42	0.14
98	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业	1171 HK	香港交易所	中国香港	476000	2,038,182.83	0.14
99	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	中升控股	881 HK	香港交易所	中国香港	565500	2,029,926.72	0.14
100	TENWOW INTERNATIONA L HOLDING	天喔国际	1219 HK	香港交易所	中国香港	1072000	1,997,329.60	0.13
101	NANJING SINOLIFE UNITED CO-H	南京中生	3332 HK	香港交易所	中国香港	868000	1,988,167.54	0.13
102	BOC HONGKONG HOLDINGS Ltd	复星国际	2388 HK	香港交易所	中国香港	100000	1,982,834.40	0.13
103	CAFE DE CORAL HOLDINGS LTD	大家乐集团	341 HK	香港交易所	中国香港	94000	1,952,237.21	0.13
104	FOSUN INTERNATIONA L	复星国际	656 HK	香港交易所	中国香港	224168	1,915,896.65	0.13



105	GUOLIAN SECURITIES CO LTD-H	国联证券股份有限公司	1456 HK	香港交易所	中国香港	519500	1,869,244.48	0.12
106	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	国泰君安国际	1788 HK	香港交易所	中国香港	801200	1,800,923.02	0.12
107	EMPEROR WATCH & JEWELLERY	英皇钟表珠宝	887 HK	香港交易所	中国香港	12370000	1,797,285.54	0.12
108	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	玖龙纸业	2689 HK	香港交易所	中国香港	352000	1,771,970.22	0.12
109	UANENG RENEWABLES CORP-H	华能新能源	958 HK	香港交易所	中国香港	794000	1,744,022.51	0.12
110	C C LAND HOLDINGS LTD	中渝置地	1224 HK	香港交易所	中国香港	991000	1,736,304.84	0.12
111	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	金风科技	2208 HK	香港交易所	中国香港	192000	1,736,142.45	0.12
112	CHAOWEI POWER HOLDINGS LTD	超威动力	951 HK	香港交易所	中国香港	400000	1,634,129.04	0.11
113	INNER MONGOLIA YITAI COAL -H	伊泰煤炭	3948 HK	香港交易所	中国香港	473800	1,615,721.16	0.11
114	COGOBUY GROUP	科通芯城	400 HK	香港交易所	中国香港	148000	1,571,020.21	0.10
115	TUNIUI CORP-SPON ADR	途牛	TOUR US	美国交易所	美国	27577	1,541,582.32	0.10
116	CHINA FOODS LTD	中国食品	506 HK	香港交易所	中国香港	700000	1,537,551.33	0.10
117	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	上海石化	338 HK	香港交易所	中国香港	500000	1,512,765.90	0.10
118	BEIJING CHUNLIZHENGDA MEDI-H	春立医疗	1858 HK	香港交易所	中国香港	134600	1,440,283.05	0.10
119	TOWNGAS CHINA CO LTD	港华燃气	1083 HK	香港交易所	中国香港	367000	1,383,257.75	0.09
120	LE SAUNDA HOLDINGS	利信达集团	738 HK	香港交易所	中国香港	957400	1,350,130.75	0.09
121	JILIN PROVINCE HUINAN-H	吉林长龙药业	8049 HK	香港交易所	中国香港	888000	1,305,388.77	0.09
122	FAIWOOD	大快活集团公司	52 HK	香港交易所	中国香港	50000	1,279,868.33	0.09

	HOLDINGS LTD							
123	CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	中集集团	2039 HK	香港交易所	中国香港	152500	1,243,416.65	0.08
124	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	深圳高速公路股份	548 HK	香港交易所	中国香港	200000	1,205,084.70	0.08
125	SHANDONG CHENMING PAPER-H	晨鸣纸业	1812 HK	香港交易所	中国香港	243500	1,192,482.59	0.08
126	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS	数据通电讯	315 HK	香港交易所	中国香港	100000	1,179,444.60	0.08
127	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	龙源电力	916 HK	香港交易所	中国香港	205000	1,124,831.19	0.07
128	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	龙光地产	3380 HK	香港交易所	中国香港	470000	1,120,728.77	0.07
129	CHINA OILFIELD SERVICES-H	中海油田服务	2883 HK	香港交易所	中国香港	200000	1,017,057.30	0.07
130	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	香港交易所	中国香港	100000	1,008,510.60	0.07
131	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	吉利汽车	175 HK	香港交易所	中国香港	280000	1,002,698.85	0.07
132	LEE'S PHARMACEUTICAL HLDGS	李氏大药厂	950 HK	香港交易所	中国香港	200000	981,161.16	0.07
133	ZHAOPIN LTD-SPONSORED ADR	智联招聘	ZPIN US	美国交易所	美国	9732	937,691.20	0.06
134	CHINA YONGDA AUTOMOBILES SERVICES	中国永达汽车服务控股有限公司	3669 HK	香港交易所	中国香港	320000	888,856.80	0.06
135	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	洛阳钼业	3993 HK	香港交易所	中国香港	600000	887,147.46	0.06
136	Summit Ascent Holdings Ltd	凯升集团	102 HK	香港交易所	中国香港	690000	849,200.11	0.06

137	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	北控水务集团	371 HK	香港交易所	中国香港	200000	796,552.44	0.05
138	MTR CORP	港铁公司	66 HK	香港交易所	中国香港	20000	670,061.28	0.04
139	TONLY ELECTRONICS HOLDINGS L	通力电子	1249 HK	香港交易所	中国香港	213000	664,463.19	0.04
140	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	中国铝业	2600 HK	香港交易所	中国香港	300000	623,054.43	0.04
141	ANGANG STEEL CO LTD-H	鞍钢股份	347 HK	香港交易所	中国香港	200000	589,722.30	0.04
142	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	微创医疗	853 HK	香港交易所	中国香港	150000	497,417.94	0.03
143	CHINA COAL ENERGY CO-H	中煤能源	1898 HK	香港交易所	中国香港	140000	482,204.81	0.03
144	HARBIN ELECTRIC CO LTD-H	哈尔滨电气	1133 HK	香港交易所	中国香港	182000	443,317.33	0.03
145	CRCC HIGH-TECH EQUIPMENT C-H	中国铁建高新装备	1786 HK	香港交易所	中国香港	123000	354,269.26	0.02
146	HOPEWELL HIGHWAY INFRASTRUCT	合和公路基金	737 HK	香港交易所	中国香港	103500	341,449.21	0.02
147	POU SHENG INTL HOLDINGS LTD	宝胜国际	3813 HK	香港交易所	中国香港	100000	191,446.08	0.01
148	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	六福集团	590 HK	香港交易所	中国香港	13000	189,993.14	0.01
149	FUFENG GROUP LTD	阜丰集团	546 HK	香港交易所	中国香港	83000	151,806.49	0.01
150	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	中海物业	2669 HK	香港交易所	中国香港	81333	79,244.68	0.01
151	TSUI WAH HOLDINGS LTD	翠华控股	1314 HK	香港交易所	中国香港	44000	47,758.96	0.00
152	SIJIA GROUP CO	思嘉集团	1863 HK	香港交易所	中国香港	30000	35,126.94	0.00
153	BRILLIANCE CHINA	华晨中国汽车	1114 HK	香港交易所	中国香港	2000	13,606.35	0.00

	AUTOMOTIVE							
154	CHINA SINGYES SOLA-RIGHTS	兴业太阳能股权	2983 HK	香港交易所	中国香港	40400	5,041.19	0.00
155	XINYI AUTOMOBILE GLASS	信义汽车玻璃香 港	8328 HK	香港交易所	中国香港	51500	0.00	0.00

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	1316 HK	43,131,707.66	2.76
2	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	40,683,085.95	2.61
3	CHINA LODGING GROUP-SPON ADS	HTHT US	39,035,836.30	2.50
4	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3311 HK	38,175,154.48	2.45
5	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3606 HK	35,683,347.68	2.29
6	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	33,630,607.35	2.15
7	LINK REIT	823 HK	32,788,358.53	2.10
8	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	3908 HK	31,946,334.39	2.05
9	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	31,839,971.36	2.04
10	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	29,950,309.13	1.92
11	AIA GROUP LTD	1299 HK	27,898,041.38	1.79
12	BYD CO LTD-H	1211 HK	24,981,181.19	1.60
13	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL CO LTD	338 HK	24,080,289.75	1.54
14	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	354 HK	23,582,009.92	1.51
15	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	21,165,352.69	1.36

16	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	EDU US	20,985,721.82	1.34
17	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 HK	20,544,951.63	1.32
18	POLY CULTURE GROUP CORP-H	3636 HK	19,945,009.00	1.28
19	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	576 HK	19,757,265.03	1.27
20	DAWRAYS PHARMACEUTICAL HOLD	2348 HK	19,387,099.58	1.24

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	966 HK	47,346,545.45	3.03
2	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3606 HK	46,561,619.80	2.98
3	CHINA LODGING GROUP-SPON ADS	HTHT US	42,580,095.19	2.73
4	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3311 HK	40,543,410.44	2.60
5	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	1316 HK	39,114,010.36	2.51
6	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	31,580,891.26	2.02
7	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	27,801,103.05	1.78
8	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL CO LTD	338 HK	27,621,257.40	1.77
9	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1800 HK	26,647,970.89	1.71
10	MINTH GROUP LTD	425 HK	21,671,692.13	1.39
11	CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1093 HK	21,024,114.26	1.35
12	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 HK	21,007,966.80	1.35
13	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	371 HK	20,800,858.85	1.33
14	BYD CO LTD-H	1211 HK	20,735,901.40	1.33

15	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	20,456,184.08	1.31
16	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	19,501,027.38	1.25
17	LINK REIT	823 HK	19,177,105.46	1.23
18	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	18,266,663.74	1.17
19	CHINA GAS HOLDINGS LTD	384 HK	17,910,911.05	1.15
20	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1186 HK	17,590,334.27	1.13

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,505,207,813.68
卖出收入（成交）总额	1,560,124,931.09

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	权证	2983 HK	5,041.19	—

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	YUEXIU REAL ESTATE INVEST MEN	开放式	其它基金	越秀房托资产管理 有限公司	2,408,784.83	0.16

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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。

本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

### 7.11.2 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。

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.11.3 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	2,879,244.93
2	应收证券清算款	10,314,271.50
3	应收股利	11,343,006.17
4	应收利息	70,013.04
5	应收申购款	2,848,887.24
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	27,455,422.88

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 期末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。

### 7.11.6 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(%)
15,298	59,506.90	492,926,329.63	54.15	417,410,171.67	45.85

### 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	66,978.93	0.0074

### 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	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(2012年09月04日)基金份额总额	249,999,292.07
报告期期初基金份额总额	862,261,661.58
本报告期基金总申购份额	416,613,736.39
减：本报告期基金总赎回份额	368,538,896.67
本报告期基金拆分变动份额	—



本报告期末基金份额总额	910,336,501.30
-------------	----------------

## § 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		基金交易		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(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
ABCI Security Company	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
BNP Paribas	0	8,336,040.10	0.27	—	—	—	—	—	—	—	—	7,161.02	0.30	—
BOCI Security Limited	0	177,156,384.29	5.80	—	—	—	—	—	—	—	—	161,768.54	6.72	—
BOCOM International	0	51,504,938.32	1.69	—	—	—	—	—	—	—	—	36,074.02	1.50	—
CCB International	0	72,078,045.51	2.36	—	—	—	—	—	—	854,322.72	1.62	68,145.56	2.83	—
CIMB Securities Ltd	0	164,829,635.31	5.40	—	—	—	—	—	—	—	—	144,641.33	6.01	—
CITIC Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

China Everbright Securities HK Limited	0	56,565,272.35	1.85	—	—	—	—	—	—	421,584.21	0.80	56,986.86	2.37	—
China Galaxy International Financial Holdings Limited	0	50,415,234.93	1.65	—	—	—	—	—	—	—	—	50,415.28	2.10	—
China International Capital Corp LTD	0	72,725,244.93	2.38	—	—	—	—	—	—	727,686.48	1.38	71,565.46	2.97	—
China Merchants Securities	0	190,187,820.14	6.23	—	—	—	—	—	—	—	—	186,608.12	7.76	—
DBS Vickers	0	136,111,491.28	4.46	—	—	—	—	—	—	—	—	156,957.08	6.52	—
Daiwa Capital Markets HK Limited	0	174,755,923.05	5.72	—	—	—	—	—	—	—	—	87,378.16	3.63	—
GF Securities HK	0	54,320,654.22	1.78	—	—	—	—	—	—	347,072.92	0.66	54,667.73	2.27	—
Goldman Sachs	0	353,174,531.40	11.57	—	—	—	—	—	—	38,670,656.03	73.44	189,492.18	7.87	—
Guosen Securities HK Finacial Holding CO LTD	0	21,395,748.28	0.70	—	—	—	—	—	—	1,315,681.01	2.50	11,355.70	0.47	—

Guo Yuan Securities Hong Kong Ltd	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Guotai Junan Securities HK	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
HAITONG INTERNATIONAL	0	285,437,398.25	9.35	—	—	—	—	—	—	4,612,251.03	8.76	294,094.47	12.22	—
Huatai Financial Holdings	0	14,324,474.89	0.47	—	—	—	—	—	—	—	—	14,324.48	0.60	—
ICBC International Securities	0	97,657,812.28	3.20	—	—	—	—	—	—	716,595.48	1.36	108,380.12	4.50	—
Instinet Pacific Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Jefferies	0	183,195,878.39	6.00	—	—	—	—	—	—	4,284,134.33	8.14	94,734.14	3.94	—
Macquarie Bank Limited	0	308,945,193.66	10.12	—	—	—	—	—	—	707,220.89	1.34	154,826.42	6.43	—
Morgan Stanley	0	1,820,754.48	0.06	—	—	—	—	—	—	—	—	1,713.47	0.07	—
Shenwan Hongyuan Securites H. K.	0	61,635,414.16	2.02	—	—	—	—	—	—	—	—	51,778.87	2.15	—

UOB Kay Hian Hong kong Limited	0	205,583,133.10	6.73	—	—	—	—	—	—	—	—	123,683.73	5.14	—
Essence Internatioanl Securties Hong Kong Ltd	0	18,334,073.87	0.60	—	—	—	—	—	—	—	—	27,522.45	1.14	—
国信证券	0	292,046,230.98	9.57	—	—	—	—	—	—	—	—	146,020.58	6.07	—
First Shanghai Securities	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
HSBC	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Merrill Lynch	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
State Street BankTrust Company	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
UBS Securites Asia Limited	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
广发证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
海通证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
红塔证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
华西证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

民生证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中投证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
申万宏源	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
安信证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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. 基金债券回购交易与富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）共用交易单元。

## 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
2	关于富国基金管理有限公司淘宝官方旗舰店关闭认申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年05月05日
3	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富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金的文件	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: <a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a>
2、富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金基金合同		
3、富国中国中小盘(香港上市)混合型证券投资基金托管协议		
4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件		
5、富国中国中小盘(香港上市)混合型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		

