

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
（摘要）

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。

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

本报告中财务资料未经审计。

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

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国中国中小盘混合（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

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

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

§ 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

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	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_t）按下列公式计算：

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

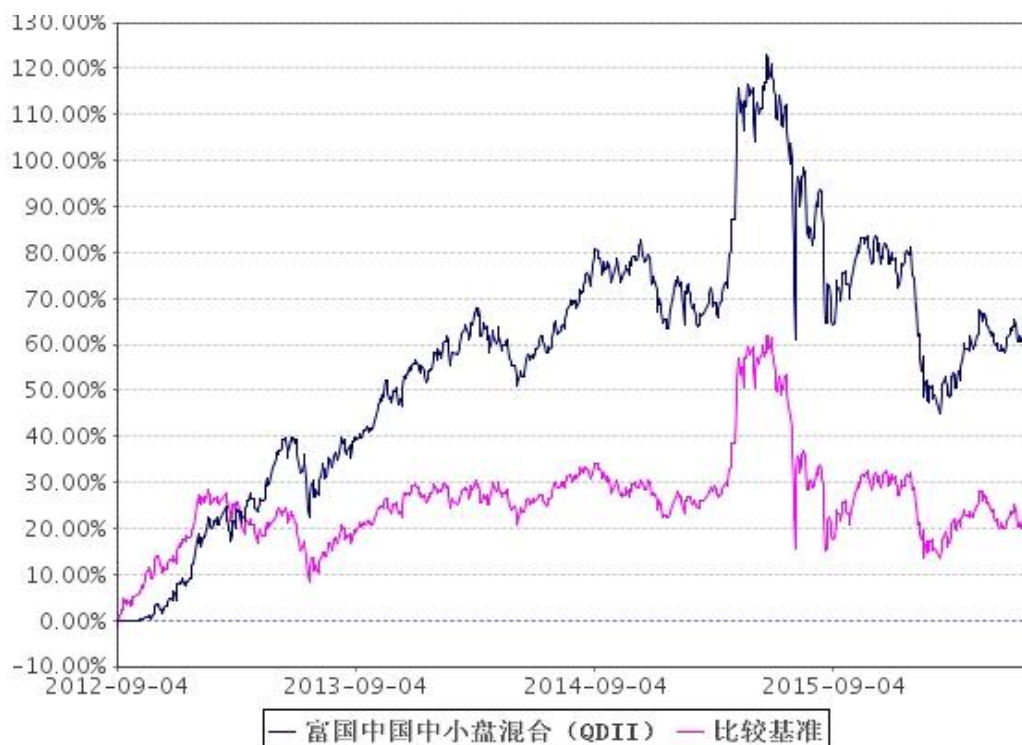
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmark_T）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	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

	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			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。

4.8 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——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)
资产：		
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)
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	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
所有者权益：		
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)
一、收入	-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
减：二、费用	16,774,315.97	17,667,245.30
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
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-131,316,970.98	58,466,640.49
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-131,316,970.98	58,466,640.49

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
-----------------	----------------------	----------------------	----------------------

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 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(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	—	—

6.4.8.1.2 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

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 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	—	—
------	------------	--------	---	---

6.4.8.1.6 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	—	—	—	—

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（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。

6.4.8.2.2 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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（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

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

6.4.9 期末（2016年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 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前十名权益投资明细

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 LT	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 HOLD	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 & CLEAR	香港交易所	388 HK	香港交易所	中国香港	221388	35,496,486.74	2.36
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	MIN TH 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 INTERNATIONA L 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 INFRASTRUCTU RE 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 INTERNATIONA L-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 INTERNATIONA L 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 EVERBRIGHT LTD	中国光大控股 (香港)	165 HK	香港交易所	中国香港	1352000	17,217,156.22	1.15

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

7.5 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	3311 HK	38,175,154.48	2.45

	CONSTRUCTION INT			
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	3606 HK	46,561,619.80	2.98

	GROUP-H			
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前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 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。

